

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2024年9月17日提出
【計算期間】	第38特定期間(自 2023年12月16日至 2024年6月17日)
【ファンド名】	世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型
【発行者名】	日興アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 ステファニー・ドゥルーズ
【本店の所在の場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【事務連絡者氏名】	新屋敷 昇
【連絡場所】	東京都港区赤坂九丁目7番1号
【電話番号】	03-6447-6147
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

国内外の不動産、債券、株式に分散投資を行ない、安定した収益の確保と中長期的な信託財産の成長をめざします。

ファンドの基本的性格

1) 商品分類

単位型投信・ 追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単位型投信	国内	株式
	海外	債券
追加型投信		不動産投信
	内外	その他資産 ()
		資産複合

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

追加型投信

一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行なわれ従来からの信託財産とともに運用されるファンドをいいます。

内外

目論見書または投資信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

資産複合

目論見書または投資信託約款において、複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

2) 属性区分

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般	年1回	グローバル (含む日本)		
大型株	年2回			
中小型株	年4回	日本		
債券		北米	ファミリーファンド	あり
一般	年6回			()
公債	(隔月)	欧州		
社債				
その他債券	年12回	アジア		
クレジット属性 ()	(毎月)	オセアニア		
	日々			
不動産投信	その他 ()	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	なし
その他資産 (投資信託証券(資産 複合 資産配分 固定型(株式、債 券、不動産投 信)))		アフリカ		
		中近東 (中東)		
		エマージング		
資産複合 ()				
資産配分固定型				
資産配分変更型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。
 その他資産(投資信託証券(資産複合 資産配分固定型(株式、債券、不動産投信)))
 当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、株式、債券および不動産投信に投資を行いません。
 よって、商品分類の「投資対象資産(収益の源泉)」においては、「資産複合」に分類されます。
 「資産配分固定型」とは、目論見書または投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率
 については固定的とする旨の記載があるものをいいます。
 年12回(毎月)
 目論見書または投資信託約款において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるものをいいます。
 グローバル(含む日本)
 目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする
 旨の記載があるものをいいます。
 ファミリーファンド
 目論見書または投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるもの
 を除きます。)を投資対象として投資するものをいいます。
 為替ヘッジなし
 目論見書または投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替の
 ヘッジを行なう旨の記載がないものをいいます。
 属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替変動リスクに対するヘッジの有無を記載して
 おります。

上記は、一般社団法人投資信託協会が定める分類方法に基づき記載しています。

上記以外の商品分類および属性区分の定義につきましては、一般社団法人投資信託協会のホームペー
 ジ(<https://www.toushin.or.jp/>)をご参照ください。

ファンドの特色



1 主として国内外の不動産、債券および株式に投資を行ないます。

- 国内外の不動産、債券および株式の3つの異なる資産へ投資を行ない、安定した収益の確保と中長期的な信託財産の成長をめざします。



2 国際分散投資で安定的な値動きをめざします。

- 投資信託証券(マザーファンド)への投資を通じて、原則として国内外の各3資産へそれぞれ純資産総額の6分の1を基本に国際分散投資を行ないます。



3 原則として、毎月、安定した収益分配を行なうことをめざします。

- インカム収益に加え、キャピタル収益を原資として、毎月の安定的な分配をめざします。
- 毎月15日(休業日の場合は翌営業日)を決算日とします。

※毎決算時に、分配金額は、委託会社が決定するものとし、原則として安定した分配を継続的に行なうことをめざします。

※分配金額は収益分配方針に基づいて委託会社が決定しますが、委託会社の判断により分配金額を変更する場合や、分配を行なわない場合があります。



「財産3分法」とは？

財産を「不動産・現金(預金)・株式」の3つの資産に分けて保管・運用することを「財産3分法」といいます。

先達の知恵として、財産を3つの資産に分散することで、安定性・流動性・収益性を保ちながら資産形成が行なわれてきました。

※市況動向および資金動向などにより上記のような運用ができない場合があります。



主として国内外の不動産、債券および株式に投資を行います。

【世界の財産3分法ファンド】
基本組入比率

国内の不動産投資信託市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)

東証REIT指数(配当込み)

国内の株式市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)

TOPIX(東証株価指数)配当込み

海外の不動産投資信託市場全体に連動する投資成果をめざします。

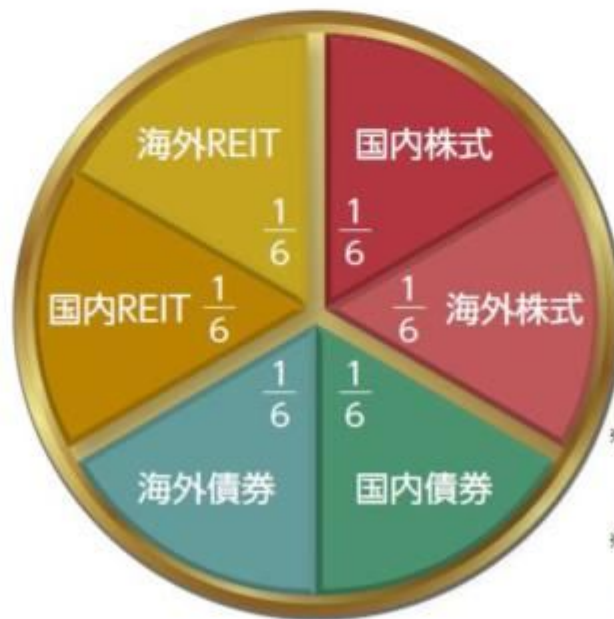
連動をめざす指数(インデックス)

S&P先進国REIT指数
(除く日本、税引後配当込み、
ヘッジなし・円ベース)

海外の株式市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)

MSCI-KOKUSAI インデックス
(税引後配当込み、
円ヘッジなし・円ベース)



※「基本組入比率」および「連動をめざす指数(インデックス)」は、2024年6月末現在のものであり、将来変更となる場合があります。
※市況動向および資金動向などにより左記のような運用ができない場合があります。

海外の債券市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)

FTSE世界国債インデックス
(除く日本、ヘッジなし・円ベース)

国内の債券市場全体に連動する投資成果をめざします。

連動をめざす指数(インデックス)

NOMURA-BPI総合



国際分散投資で安定的な値動きをめざします。

それぞれの資産は、異なる値動きをする傾向があります。

各資産の値動きの特徴

	REIT(不動産投資)	債券	株式
景気が良くなると	空室率や賃料水準が改善傾向  価格は上がる傾向	金利が上がる傾向  債券価格は下がる傾向	企業業績が改善する傾向  株価は上がる傾向
景気が悪くなると	空室率や賃料水準が悪化の傾向  価格は下がる傾向	金利が下がる傾向  債券価格は上がる傾向	企業業績が悪化する傾向  株価は下がる傾向

※価格変動などに関する説明は一般論であり、実際はこれと異なる動きをする場合があります。

ご参考：設定来のファンドと各資産の推移(マザーファンドベース)

(2005年9月(設定月)～2024年6月、月末値)



※基準価額は信託報酬(後述の「手続・手数料等」参照)控除後の値です。

※分配金再投資基準価額とは、税引前分配金を再投資したものと計算した理論上のものであることにご留意ください。

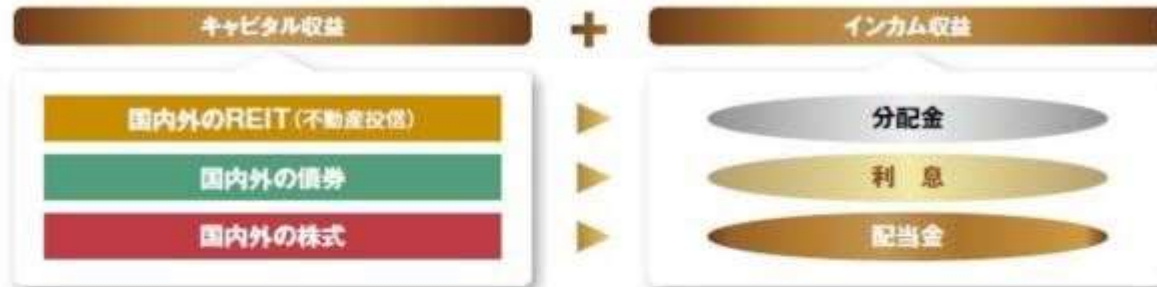
※各資産の値動きは、当ファンドが投資対象とする各マザーファンドの値動きを示しています。

※上記グラフは過去のものであり、将来の運用成果等を約束するものではありません。



インカム収益（投資した資産から生じる利息、配当金、分配金収入など）に加え、**キャピタル収益**（投資した資産自体の値上がり利益）を原資として、毎月の安定的な分配をめざします。

- 毎決算時に、分配金額は、委託会社が決定するものとし、原則として安定した分配を継続的に行なうことをめざします。
- 分配金額は収益分配方針に基づいて委託会社が決定しますが、委託会社の判断により分配金額を変更する場合や、分配を行なわない場合があります。



ご参考:各指数の利回り

(2024年6月末現在)



- ◆ REIT: 実績分配金利回り
国内: 東証REIT指数
海外: S&P先進国REIT指数(除く日本)
 - ◆ 債券: 最終利回りなど
国内: NOMURA-BPI総合
海外: FTSE世界国債インデックス(除く日本)
 - ◆ 株式: 実績配当利回りなど
国内: TOPIX(東証株価指数)
海外: MSCI-KOKUSAIインデックス
- ※利回りは切り捨てにて端数処理しています。

※各資産のリスク特性はそれぞれ異なるため、利回りだけで比較できるものではありません。
※上記は過去の各指数の利回りであり、将来の運用成果等を約束するものではありません。

各指数(インデックス)の著作権などの権利について

- **東証REIT指数** 同指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利は株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)に帰属します。また、JPXは同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。
- **S&P先進国REIT指数** 同指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利はスタンダード&プアーズ ファイナンシャル サービス エル エル シー(S&P)社に帰属します。また、S&P社は同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。
- **NOMURA-BPI総合** 同指数は、野村フィデュシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社(以下「NFRIC」)が公表している指数で、その知的財産権はNFRICに帰属します。なお、NFRICは、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行なわれる日興アセットマネジメント株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。
- **FTSE世界国債インデックス** 同指数は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
- **TOPIX(東証株価指数)** 同指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利は株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)に帰属します。また、JPXは同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。
- **MSCI-KOKUSAI インデックス** 同指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

■ファンドの仕組み

●当ファンドは、主にマザーファンドに投資するファミリーファンド方式で運用を行ないます。



(主な投資制限)

- ・投資信託証券、短期社債等、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。
- ・外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

(分配方針)

- ・毎決算時に、分配金額は、委託会社が決定するものとし、原則として、安定した分配を継続的に行なうことをめざします。
- ※将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

収益分配金に関する留意事項

- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

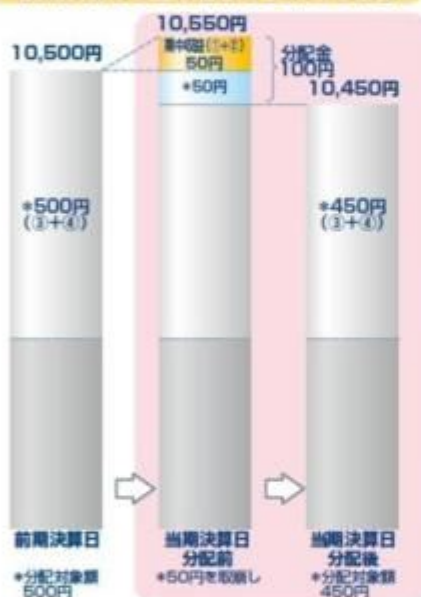
投資信託で分配金が支払われるイメージ



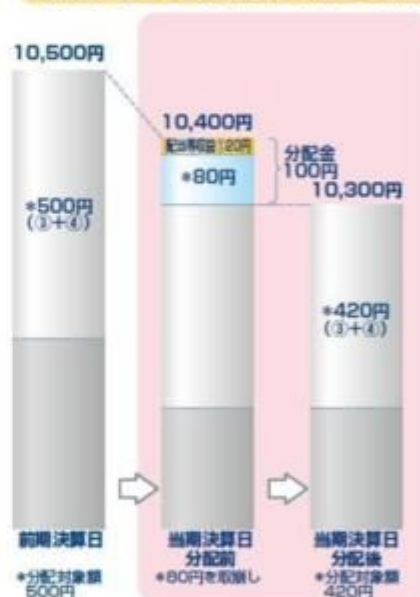
- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合

前期決算から基準価額が上昇した場合



前期決算から基準価額が下落した場合



(注) 分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。
※上記はイメージであり、将来の分配金の支払いおよび金額ならびに基準価額について示唆、保証するものではありません。

- 投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合



分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



※元本払戻金(特別分配金)は実質的に元本の一部払戻しとみなされ、その金額だけ個別元本が減少します。また、元本払戻金(特別分配金)部分は非課税扱いとなります。

- ・ 普通分配金：個別元本(投資者のファンドの購入価額)を上回る部分からの分配金です。
- ・ 元本払戻金：個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者の個別元本は、(特別分配金)元本払戻金(特別分配金)の額だけ減少します。

信託金限度額

- ・ 30兆円を限度として信託金を追加することができます。
- ・ 委託会社は受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

(2) 【ファンドの沿革】

2005年 9月29日

- ・ ファンドの信託契約締結、当初自己設定、運用開始

2006年 3月9日

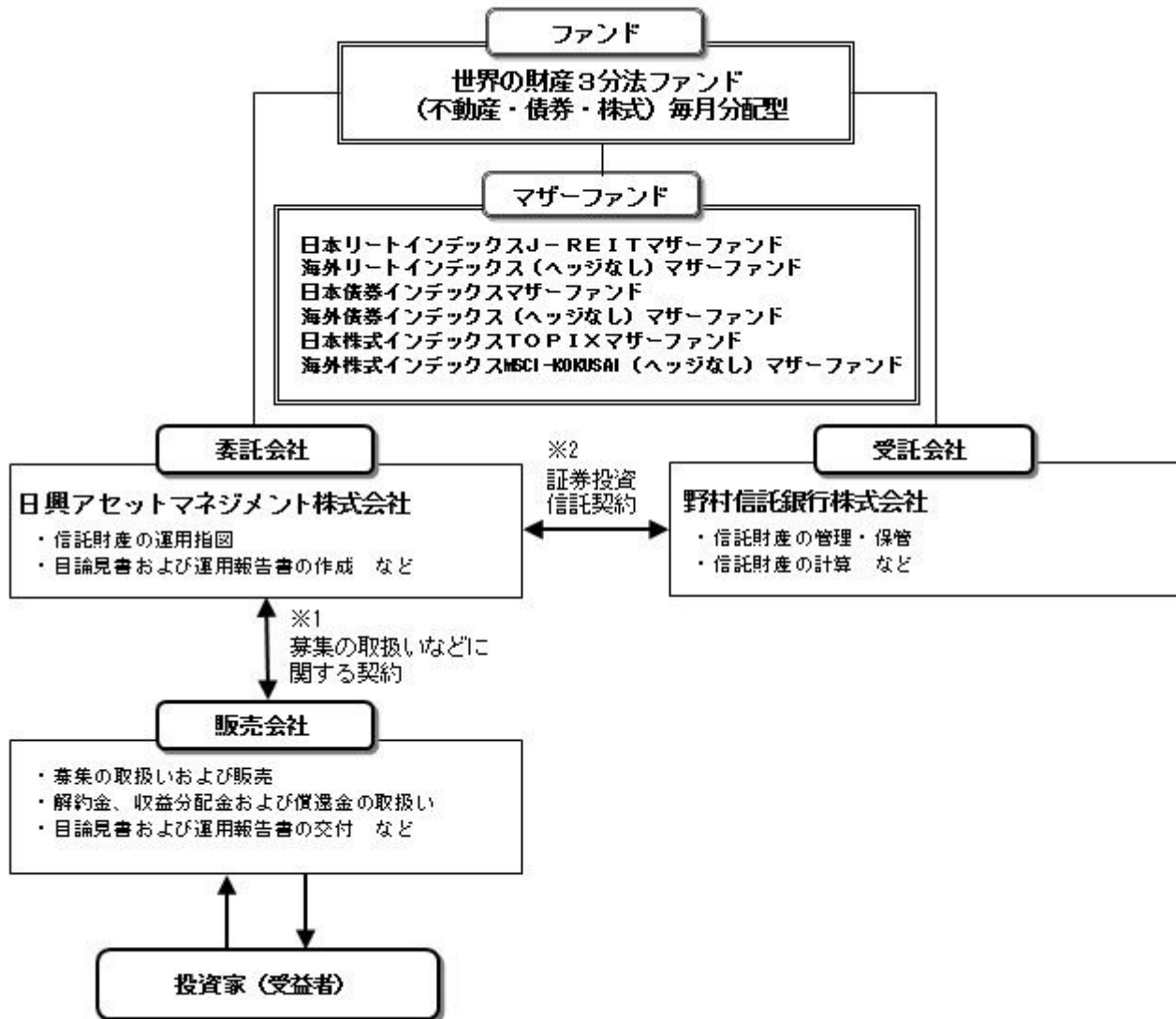
- ・ ファンド名称変更

新名称：世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型

旧名称：世界の財産3分法ファンド（バランス重視）毎月分配型

(3) 【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



- 1 投資信託を販売するルールを委託会社と販売会社の間で規定したものを。販売会社が行なう募集の取扱い、収益分配金・償還金の支払い、解約請求の受付の業務範囲の取決めの内容などが含まれています。
- 2 投資信託を運営するルールを委託会社と受託会社の間で規定したものを。運用の基本方針、投資対象、投資制限、信託報酬、受益者の権利、募集方法の取決めの内容などが含まれています。

委託会社の概況（2024年6月末現在）

- 1) 資本金
17,363百万円
- 2) 沿革
1959年：日興証券投資信託委託株式会社として設立
1999年：日興国際投資顧問株式会社と合併し「日興アセットマネジメント株式会社」に社名変更
- 3) 大株主の状況

名称	住所	所有株数	所有比率
三井住友トラスト・ホールディングス株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	192,211,000株	97.562%

2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

- ・主として、以下に掲げる各投資信託証券に投資を行ない、安定した収益の確保と中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
- ・各マザーファンドへの投資比率は、原則として、信託財産の純資産総額の6分の1を基本としますが、資金動向やその見通しなどによっては5%から25%の範囲内で組入比率を変更する場合があります。
証券投資信託「日本リートインデックスJ-REITマザーファンド」
証券投資信託「海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド」

- 証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」
 証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」
 証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」
 証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド」
 ・特に「日本リートインデックス」-REITマザーファンド」や「海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド」においては、投資対象としている資産の流動性が他のマザーファンドと比べて相対的に低い場合、資金の流出入に備える場合や純資産規模が大きくなった場合などには両マザーファンドの組入比率をそれぞれ5%を下限として引き下げることがあります。両マザーファンドの組入比率を引き下げた場合には、現金の比率を高くする場合や他のマザーファンドの組入比率をそれぞれ25%を上限に引き上げる場合があります。また、組入比率はファンド全体として国内資産の実質組入比率と海外資産の実質組入比率が概ね50%程度ずつになるように決定します。
- ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

（２）【投資対象】

- ＜世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型＞
 投資信託証券（投資信託または外国投資信託の受益証券（振替投資信託受益権を含みます。）および投資法人または外国投資法人の投資証券をいいます。以下同じ。）を主要投資対象とします。
 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
- 1) 有価証券
 - 2) 金銭債権
 - 3) 約束手形
 - 4) 為替手形
- 主として次のマザーファンドの受益証券ならびに次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。
- 1) 証券投資信託「日本リートインデックス」-REITマザーファンド」
 - 2) 証券投資信託「海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド」
 - 3) 証券投資信託「日本債券インデックスマザーファンド」
 - 4) 証券投資信託「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」
 - 5) 証券投資信託「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」
 - 6) 証券投資信託「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド」
 - 7) 短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）およびコマーシャル・ペーパー
 - 8) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、7)の証券の性質を有するもの
 - 9) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいい、マザーファンドの受益証券を除きます。）
 - 10) 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）のうち投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）に類する証券以外のもの
 - 11) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
- 次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
- 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
- 次の取引ができます。
- 1) 外国為替予約取引
 - 2) 資金の借入
- ＜日本リートインデックス」-REITマザーファンド＞
 わが国の金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
- 1) 有価証券
 - 2) 金銭債権
 - 3) 約束手形
 - 4) 為替手形
- 主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。
- 1) 短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）およびコマーシャル・ペーパー
 - 2) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
 - 3) 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）のうち投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）に類する証券以外のもの
 - 4) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
- 次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
- 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

- 3) コール・ローン
 4) 手形割引市場において売買される手形
- < 海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド >
 日本を除く世界各国の金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
- 1) 有価証券
 - 2) 金銭債権
 - 3) 約束手形
 - 4) 為替手形
- 主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。
- 1) 短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）およびコマーシャル・ペーパー
 - 2) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1)の証券の性質を有するもの
 - 3) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
 - 4) 投資証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）のうち投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）に類する証券以外のもの
 - 5) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
- 次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
- 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
- 次の取引ができます。
- 1) 外国為替予約取引
- < 日本債券インデックスマザーファンド >
 わが国の公社債を主要投資対象とします。
 投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
- 1) 有価証券（株券、出資証券ならびにこれらと同等の性質を有する証券等を除きます。）
 - 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいひ、約款第12条、第13条および第14条に定めるものに限ります。）
 - 3) 金銭債権
 - 4) 約束手形
 - 5) 為替手形
- 主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券（短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）を除きます。）には投資しません。
- 1) 国債証券
 - 2) 地方債証券
 - 3) 特別の法律により法人の発行する債券
 - 4) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）に限ります。）
 - 5) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 - 6) コマーシャル・ペーパー
 - 7) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、1)～6)の証券の性質を有するもの
 - 8) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券
 - 9) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 - 10) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。
- 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- 次の取引ができます。
- 1) 先物取引等
 - 2) スワップ取引
 - 3) 金利先渡取引
 - 4) 有価証券の貸付
 - 5) 公社債の空売
 - 6) 公社債の借入
- < 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド >

内外の公社債を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券（株券、出資証券ならびにこれらと同等の性質を有する証券等を除きます。）
- 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第12条、第13条および第14条に定めるものに限りません。）
- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形
- 5) 為替手形

主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券（短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）を除きます。）には投資しません。

- 1) 国債証券
- 2) 地方債証券
- 3) 特別の法律により法人の発行する債券
- 4) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）に限りません。）
- 5) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 6) コマーシャル・ペーパー
- 7) 外国または外国の者の発行する証券で、1)～6)の証券の性質を有するもの
- 8) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）で投資法人債券に類する証券
- 9) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- 10) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 11) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。）
- 12) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
- 13) 外国の者に対する権利で12)の有価証券の性質を有するもの

次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することができます。

- 1) 預金
- 2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
- 3) コール・ローン
- 4) 手形割引市場において売買される手形
- 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの

次の取引ができます。

- 1) 先物取引等
- 2) スワップ取引
- 3) 金利先渡取引
- 4) 為替先渡取引
- 5) 有価証券の貸付
- 6) 公社債の空売
- 7) 公社債の借入
- 8) 外国為替予約取引

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 有価証券
- 2) デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第15条、第16条および第17条に定めるものに限りません。）
- 3) 金銭債権
- 4) 約束手形
- 5) 為替手形

主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券（短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）を除きます。）には投資しません。

- 1) 株券または新株引受権証券
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 6) 特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 7) コマーシャル・ペーパー
- 8) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
- 9) 外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、2)～8)の証券の性質を有するもの
- 10) 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。）または

- 外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)で投資法人債券に類する証券
- 11) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
 - 12) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
 - 13) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
 - 14) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することができます。
 - 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 次の取引ができます。
 - 1) 信用取引
 - 2) 先物取引等
 - 3) スワップ取引
 - 4) 金利先渡取引
 - 5) 有価証券の貸付
 - 6) 公社債の空売
 - 7) 公社債の借入
- < 海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI(ヘッジなし)マザーファンド >
日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
- 1) 有価証券
 - 2) デリバティブ取引に係る権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第14条、第15条および第16条に定めるものに限ります。)
 - 3) 金銭債権
 - 4) 約束手形
 - 5) 為替手形
- 主として次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することができます。ただし、私募により発行された有価証券(短期社債等(社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。)を除きます。)には投資しません。
- 1) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の株券または新株引受権証書
 - 2) 国債証券
 - 3) 地方債証券
 - 4) 特別の法律により法人の発行する債券
 - 5) 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。)の新株引受権証券を除きます。)
 - 6) 特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
 - 7) コマーシャル・ペーパー
 - 8) 外国または外国の者の発行する外国通貨表示の新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券
 - 9) 外国または外国の者の発行する証券で、2)~7)の証券の性質を有するもの
 - 10) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
 - 11) 投資証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。)で12)に定めるもの以外のもの
 - 12) 投資法人債券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下同じ。)または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
 - 13) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
 - 14) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
 - 15) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
 - 16) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 - 17) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
 - 18) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 - 19) 外国の者に対する権利で18)の有価証券の性質を有するもの
次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することができます。
 - 1) 預金
 - 2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
 - 3) コール・ローン
 - 4) 手形割引市場において売買される手形
 - 5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 - 6) 外国の者に対する権利で5)の権利の性質を有するもの
 次の取引ができます。
 - 1) 信用取引
 - 2) 先物取引等
 - 3) スワップ取引

- 4) 金利先渡取引
- 5) 為替先渡取引
- 6) 有価証券の貸付
- 7) 公社債の空売
- 8) 公社債の借入
- 9) 外国為替予約取引

投資対象とする投資信託証券の概要

<日本リートインデックスJ - R E I Tマザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	わが国の金融商品取引所に上場する不動産投信（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。）の投資信託証券（以下「不動産投資信託証券」といいます。）に投資を行ない、東証R E I T指数（配当込み）*の動きに連動する投資成果を目標として運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主として、東京証券取引所に上場する不動産投資信託証券に投資を行ない、東証R E I T指数（配当込み）の動きに連動した投資成果をめざします。 ・不動産投資信託証券の組入比率は、高位を維持することを基本とします。 ・ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・投資信託証券、短期社債等、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。 ・有価証券先物取引等のデリバティブ取引ならびに有価証券の貸付、空売りおよび借入れは行ないません。 ・投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資は行ないません。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり）
その他の費用など	組入る有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（2005年6月30日設定）
決算日	毎年6月15日（休業日の場合は翌営業日）

* 東証R E I T指数（配当込み）は、株式会社東京証券取引所が発表している、東京証券取引所に上場しているJ - R E I T全銘柄に投資した場合の投資成果（市場における価格の変動と分配金の受取りを合わせた投資成果）を表す指数です。

東証R E I T指数の指数値および東証R E I T指数に係る標章または商標は、株式会社J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社（以下「J P X」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証R E I T指数に関するすべての権利・ノウハウおよび東証R E I T指数に係る標章または商標に関するすべての権利はJ P Xが有します。J P Xは、東証R E I T指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。当ファンドは、J P Xにより提供、保証または販売されるものではなく、当ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJ P Xは責任を負いません。

<海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド>

運用の基本方針

基本方針	世界各国の金融商品取引所に上場する不動産投信（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投信等をいいます。）の投資信託証券（以下「不動産投資信託証券」といいます。）に投資を行ない、S & P先進国REIT指数（除く日本、税引後配当込み、ヘッジなし・円ベース） [*] の動きに連動する投資成果を目標として運用を行ないます。
主な投資対象	日本を除く世界各国の金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 主として、日本を除く世界各国の金融商品取引所に上場する不動産投資信託証券に投資を行ない、S & P先進国REIT指数（除く日本、税引後配当込み、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動した投資成果をめざします。 不動産投資信託証券の組入比率は、高位を維持することを基本とします。 外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジは行ないません。 ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 投資信託証券、短期社債等、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。 有価証券先物取引等のデリバティブ取引ならびに有価証券の貸付、空売りおよび借入れは行ないません。 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。

ファンドに係る費用

信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり）
その他の費用など	組入る有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。

その他

委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（2005年6月30日設定）
決算日	毎年6月15日（休業日の場合は翌営業日）

^{*} S & P先進国REIT指数（除く日本）は、スタンダード・プアーズ・ファイナンシャル・サービシーズ・エル・エル・シー（S & P社）が発表している、日本を除く世界の主要国の不動産投信市場の合成パフォーマンスを表す指数です。

同指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利はS & P社に帰属します。また、S & P社は同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

<日本債券インデックスマザーファンド>

運用の基本方針

基本方針	わが国の債券市場の動きをとらえることを目標に、NOMURA-BPI総合 [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 主としてわが国の公社債に投資し、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的のため、債券先物取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式への投資は行ないません。 ・外貨建資産への投資は行ないません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.1%（1口当たり）
その他の費用など	組入る有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（1998年10月30日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

* NOMURA-BPI 総合は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社（以下「NFRC」）が公表している、わが国の債券市場の動きを示す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。国債、地方債、政府保証債、金融債、事業債、円建外債、MBS、ABSなど、国内で発行された円建公募利付債で構成されています。対象となる債券は残存期間1年以上、残存額面10億円以上で、事業債、円建外債、MBS、ABSについては、A格相当以上の格付を取得しているものに限られます。同指数の知的財産権はNFRCに帰属します。なお、NFRCは、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行なわれる日興アセットマネジメント株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

< 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	世界の主要国の債券市場の動きをとらえることを目標に、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース） [*] の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	内外の公社債を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> ・主として世界各国の債券に投資し、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 ・投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的のため、債券先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ・外貨建資産への投資にあたっては、原則として為替ヘッジを行ないません。 ・ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式への投資は行ないません。 ・外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ・デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ・一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。

信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.2%（1口当たり）
その他の費用など	組入る有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（1998年10月30日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

* FTSE世界国債インデックス（除く日本）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権などの知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

<日本株式インデックスTOPIXマザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、TOPIX（東証株価指数）* 配当込みの動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 主としてわが国の株式に投資し、TOPIX（東証株価指数）配当込みの動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的のため、株価指数先物取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。 ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への投資は行ないません。 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり）
その他の費用など	組入る有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（1999年10月29日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

* TOPIX（東証株価指数）は、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、指数採用銘柄の浮動株調整後の時価総額を指数化したものです。

TOPIXの指数値およびTOPIXに係る標章または商標は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXに係る標章または商標に関するすべての権利はJPXが有します。JPXは、TOPIXの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。当ファンドは、JPXにより提供、保証または販売されるものではなく、当ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJPXは責任を負いません。

< 海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド >

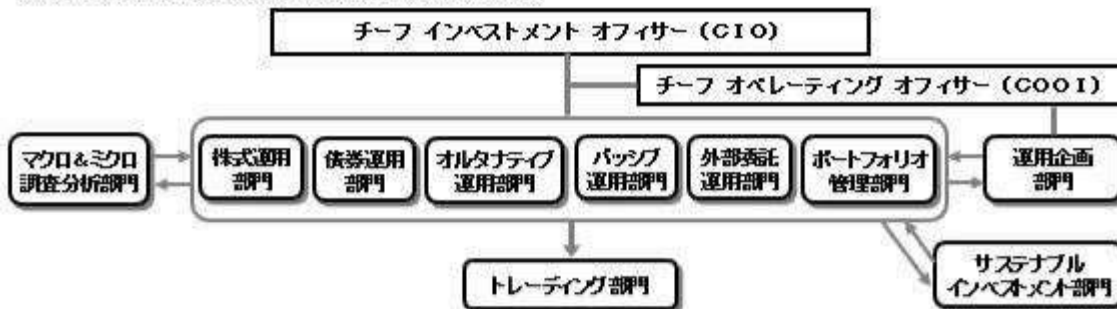
運用の基本方針	
基本方針	世界の主要国の株式市場の動きをとらえることを目標に、MSCI-KOKUSAIインデックス*（税引後配当込み、円ヘッジなし・円ベース）に連動する投資成果を目指して運用を行ないます。
主な投資対象	日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資方針	<ul style="list-style-type: none"> 主として日本を除く世界各国の株式（DR（預託証券）およびカントリーファンド等を含みます。）に投資し、MSCI-KOKUSAIインデックス（税引後配当込み、円ヘッジなし・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的のため、株価指数先物取引や外国為替予約取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。 ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。
主な投資制限	<ul style="list-style-type: none"> 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。 投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとし、 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。
収益分配	収益分配は行ないません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	解約時の基準価額に対し0.3%（1口当たり）
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
委託会社	日興アセットマネジメント株式会社
受託会社	野村信託銀行株式会社
信託期間	無期限（2000年5月17日設定）
決算日	毎年10月26日（休業日の場合は翌営業日）

* MSCI-KOKUSAI インデックスは、MSCI Inc. が発表している、日本を除く世界の主要国の株式市場の合成パフォーマンスを表す指数です。

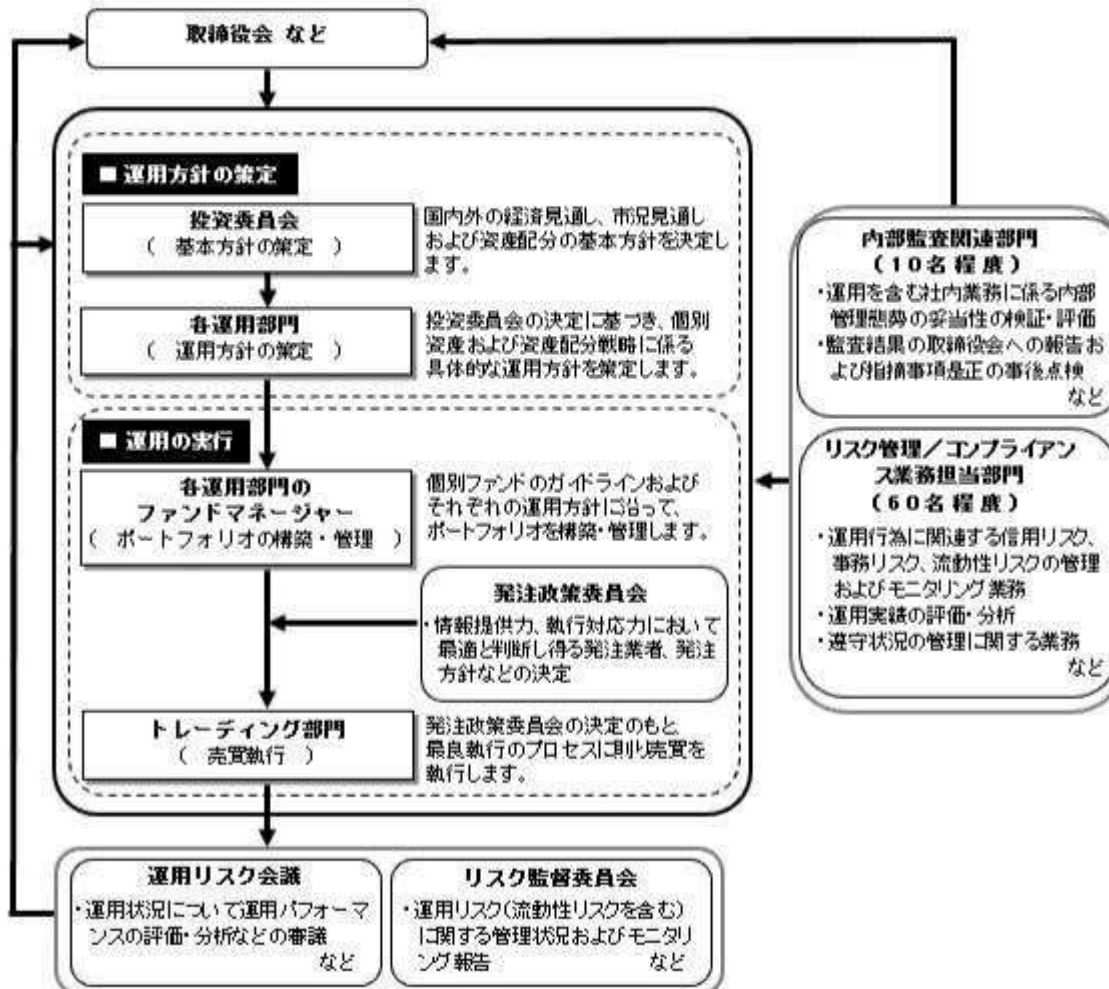
同指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は、同指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

(3) 【運用体制】

◆委託会社における運用体制は以下の通りです。



◆委託会社の運用体制における内部管理および意思決定を監督する組織などは以下の通りです。



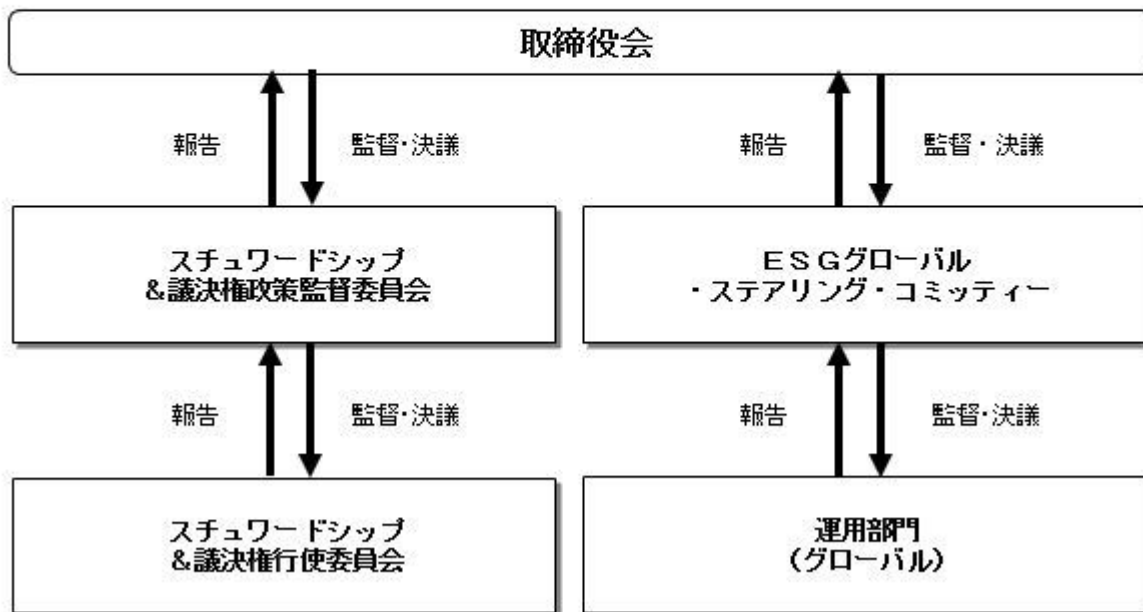
委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

「受託会社」に対しては、日々の純資産照会、月次の勘定残高照会などを行っております。また、独立した監査法人が所定の手続きで受託業務について監査を行っており、内部統制が有効に機能している旨の監査報告書を定期的に受け取っております。

◆投資家としてのESG/フィデューシャリー・デューティ

ESG（環境、社会、企業統治）やフィデューシャリーは、当委託会社にとって最高位に位置する概念であるため、同原則に関連する決議、報告、議論は、当委託会社の取締役会にて行なうこととしています。

（スチュワードシップ&議決権政策監督委員会は、議長含め社外委員が過半数以上を占めるメンバーで構成されています）



上記体制は2024年6月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行なう方針です。

- 1) 分配対象額の範囲
経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）などの全額とします。
 - 2) 分配対象額についての分配方針
分配金額は、委託会社が決定するものとし、原則として、安定した分配を継続的に行なうことをめざします。
 - 3) 留保益の運用方針
収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、約款に定める運用の基本方針に基づき運用を行ないます。
- 収益分配金の支払い
- < 分配金再投資コース >
原則として、収益分配金は税金を差し引いた後、無手数料で自動的に再投資されます。
- < 分配金受取りコース >
毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して5営業日まで）から収益分配金を支払います。支払いは販売会社において行なわれます。

(5) 【投資制限】

約款に定める投資制限

< 世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型 >

- 1) 投資信託証券、短期社債等（社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。）、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。
- 2) 有価証券先物取引等のデリバティブ取引ならびに有価証券の貸付、空売りおよび借入れは行ないません。
- 3) 投資信託証券への実質投資割合には、制限を設けません。
- 4) 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- 5) 信託財産に属する外貨建資産の時価総額と投資信託証券の信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。
- 6) 信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、解約に伴う支払資金の手当て（解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、および再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。資金借入額および借入期間は、次に掲げる要件を満たす範囲内とします。
 - イ) 解約に伴う支払資金の手当てにあたっては、解約金の支払資金の手当てのために行なった有価

証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範囲内

- ロ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てにあたっては、収益分配金の再投資額の範囲内
- ハ) 借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%以内
- 二) 解約に伴なう支払資金の手当てのための借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とします。

ホ) 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てのための借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとします。

- 7) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

<日本リートインデックスJ-REITマザーファンド>

- 1) 投資信託証券、短期社債等(社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。)、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。

- 2) 有価証券先物取引等のデリバティブ取引ならびに有価証券の貸付、空売りおよび借入れは行ないません。

- 3) 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

- 4) 外貨建資産への投資は行ないません。

- 5) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

<海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド>

- 1) 投資信託証券、短期社債等(社債、株式等の振替に関する法律第66条第1号に規定する短期社債、同法第117条に規定する相互会社の社債、同法第118条に規定する特定社債および同法第120条に規定する特別法人債をいいます。)、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。

- 2) 有価証券先物取引等のデリバティブ取引ならびに有価証券の貸付、空売りおよび借入れは行ないません。

- 3) 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

- 4) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

- 5) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

<日本債券インデックスマザーファンド>

- 1) 株式への投資は行ないません。

- 2) 外貨建資産への投資は行ないません。

- 3) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)、および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。

- 4) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

- 5) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

- 6) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、金利先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

- 7) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する公社債の貸付の指図をすることができます。公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。

- 8) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

- 9) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

- 10) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法

により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

- 11) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

< 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド >

- 1) 株式への投資は行ないません。
- 2) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- 3) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 4) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに為替変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- 5) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 6) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的のため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 7) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的のため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 8) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する公社債の貸付の指図をすることができます。公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 9) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 10) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 11) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに為替変動リスクを回避する目的のため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- 12) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 13) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

< 日本株式インデックスTOPIXマザーファンド >

- 1) 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には、制限を設けません。
- 2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場（金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。）されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- 3) 外貨建資産への投資は行ないません。
- 4) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 5) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 6) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるわが国の金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 7) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。

す。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

- 8) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、金利先渡し取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡し取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 9) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 - イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
 - ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 10) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 12) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 13) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

< 海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI (ヘッジなし) マザーファンド >

- 1) 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資割合には、制限を設けません。
- 2) 投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所が開設する市場に上場(金融商品取引所が開設する市場に準ずる市場等において取引されている場合を含みます。)されている株式等の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- 3) 投資信託証券への投資は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 4) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- 5) 信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 6) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
- 7) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに為替変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- 8) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクを回避する目的のため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- 9) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的のため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 10) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的のため、金利先渡し取引および為替先渡し取引を行なうことの指図をすることができます。金利先渡し取引および為替先渡し取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則としてマザーファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 11) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
 - イ) 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
 - ロ) 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- 12) 信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売り付けることの指図をすることができます。当該売付けの指図は、当該売付けにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 13) 信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。公社債の借入れの指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- 14) 投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに為替変動リスクを回避する目的のため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。外国為替の売買の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- 15) デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところに従い、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 16) 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポ

ジャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

法令による投資制限

同一法人の発行する株式(投資信託及び投資法人に関する法律)

同一法人の発行する株式について、委託会社が運用の指図を行なう投資信託全体で、当該株式の議決権の過半数を保有することとなる取引は行ないません。

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

当ファンドの投資にあたっては、主に以下のリスクを伴います。お申込みの際は、当ファンドのリスクを十分に認識・検討し、慎重に投資のご判断を行なっていただく必要があります。

- ・投資者の皆様の投資元金は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元金を割り込むことがあります。ファンドの運用による損益はすべて投資者(受益者)の皆様に帰属します。なお、当ファンドは預貯金とは異なります。
- ・当ファンドは、主に不動産投信、債券および株式を実質的な投資対象としますので、不動産投信、債券および株式の価格の下落や、不動産投信、債券および株式の発行体の財務状況や業績の悪化、不動産の市況の悪化などの影響により、基準価額が下落し、損失を被ることがあります。また、外貨建資産に投資する場合には、為替の変動により損失を被ることがあります。

投資対象とする投資信託証券の主なリスクは以下の通りです。

価格変動リスク

- ・一般に不動産投信は、不動産や不動産証券化商品に投資して得られる収入や売却益などを収益源としており、不動産を取り巻く環境や規制、賃料水準、稼働率、不動産市況や長短の金利動向、マクロ経済の変化など様々な要因により価格が変動します。また、不動産の老朽化や立地条件の変化、火災、自然災害などに伴う不動産の滅失・毀損などにより、その価格が影響を受ける可能性もあります。不動産投信の財務状況、業績や市況環境が悪化する場合、不動産投信の分配金や価格は下がり、ファンドに損失が生じるリスクがあります。
- ・一般に公社債は、金利変動により価格が変動するリスクがあります。一般に金利が上昇した場合には価格は下落し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。ただし、その価格変動幅は、残存期間やクーポンレートなどの発行条件などにより債券ごとに異なります。
- ・一般に株式の価格は、会社の成長性や収益性の企業情報および当該情報の変化に影響を受けて変動します。また、国内および海外の経済・政治情勢などの影響を受けて変動します。ファンドにおいては、株式の価格変動または流動性の予想外の変動があった場合、重大な損失が生じるリスクがあります。

流動性リスク

市場規模や取引量が少ない状況においては、有価証券の取得、売却時の売買価格は取引量の大きさに影響を受け、市場実勢から期待できる価格どおりに取引できないリスク、評価価格どおりに売却できないリスク、あるいは、価格の高低に関わらず取引量が限られてしまうリスクがあり、その結果、不測の損失を被るリスクがあります。

信用リスク

- ・不動産投信が支払不能や債務超過の状態になった場合、またはそうなることが予想される場合、ファンドにも重大な損失が生じるリスクがあります。また、金融商品取引所が定める一定の基準に該当した場合、上場が廃止される可能性があり、廃止される恐れが生じた場合や廃止となる場合も不動産投信の価格は下がり、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあります。
- ・一般に公社債および短期金融資産の発行体にデフォルト(債務不履行)が生じた場合またはそれが予想される場合には、公社債および短期金融資産の価格が下落(価格がゼロになることもあります。)し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、実際にデフォルトが生じた場合、投資した資金が回収できないリスクが高い確率で発生します。
- ・格付を有する債券については、当該格付の変更に伴わない価格が下落するリスクもあります。
- ・一般に投資した企業の経営などに直接・間接を問わず重大な危機が生じた場合には、ファンドにも重大な損失が生じるリスクがあります。デフォルト(債務不履行)や企業倒産の懸念から、発行体の株式などの価格は大きく下落(価格がゼロになることもあります。)し、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。また、金融商品取引所が定める一定の基準に該当した場合、上場が廃止される可能性があり、廃止される恐れが生じた場合や廃止となる場合も発行体の株式などの価格は下がり、ファンドにおいて重大な損失が生じるリスクがあります。
- ・ファンドの資金をコール・ローン、譲渡性預金証書などの短期金融資産で運用することがありますが、買付け相手先の債務不履行により損失が発生することがあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

為替変動リスク

外貨建資産については、一般に外国為替相場が当該資産の通貨に対して円高になった場合には、ファンドの基準価額が値下がりする要因となります。

ファンドが投資対象とする投資信託証券は、これらの影響を受けて価格が変動しますので、ファンド自身にもこれらのリスクがあります。

<その他の留意事項>

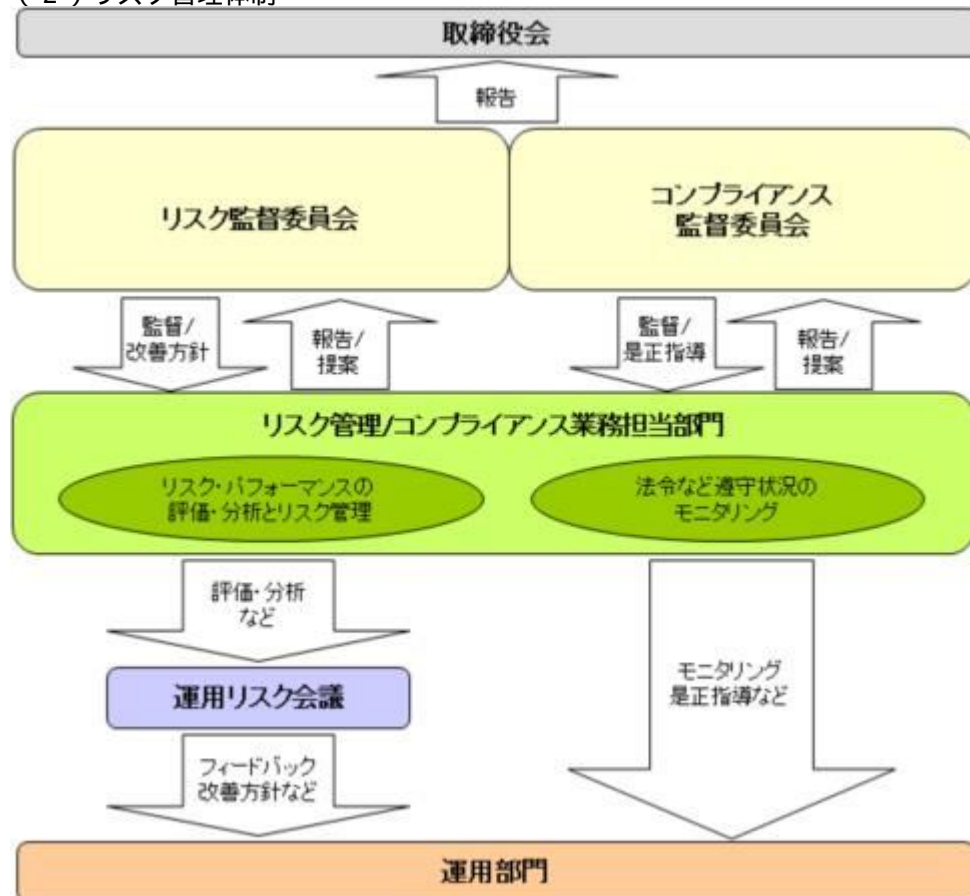
・システムリスク・市場リスクなどに関する事項

証券市場および外国為替市場は、世界的な経済事情の急変またはその国における天災地変、政変、経済事情の変化、政策の変更もしくはコンピューター・ネットワーク関係の不慮の出来事などの諸事情により有価証券取引や為替取引などが一時的に停止されることがあります。これにより、ファンドの投資方針に従った運用ができない場合があります。上記の状況が発生した場合や、その他の事由により基準価額の算出が困難となる状況が発生した場合などには、委託会社の判断により一時的に取得・

換金の取り扱いを停止することもあります。

- ・投資対象とする投資信託証券に関する事項
諸事情により、投資対象とする投資信託証券（マザーファンドが投資対象とする投資信託証券を含みます。）にかかる投資や換金ができない場合があります。これにより、ファンドの投資方針に従った運用ができなくなる場合があります。また、一時的にファンドの取得・換金ができなくなることもあります。
ファンドが投資対象とする投資信託証券（マザーファンドを含みます。）と同じ投資信託証券に投資する他のファンドにおいて、解約・償還・設定などに伴う資金流出などがあり、その結果、当該投資信託証券において有価証券の売買などが生じた場合には、ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。
- ・解約によるファンドの資金流出に伴う基準価額変動に関する事項
一度に大量の解約があった場合に、解約資金の手当てをするため保有している有価証券を一度に大量に売却することがあります。その際は評価価格と実際の取引価格に差が生じるなどして、ファンドの基準価額が大きく変動する可能性があります。
- ・基準価額の妥当性に疑義が生じた場合の取得・換金の停止に関する事項
ファンドの基準価額の算出に用いた評価価格と実際の取引価格に差が生じるなど、基準価額の妥当性に疑義が生じる場合は、委託会社の判断により、一時的に取得・換金の取扱いを停止する場合があります。
- ・運用制限や規制上の制限に関する事項
関係する法令規制上、または社内方針などにより取引が制限されることがあります。例えば、委託会社またはその関連会社が特定の銘柄の未公開情報を受領している場合には、当該銘柄の売買が制限されることがあります。また、委託会社またはその関連会社が行なう投資または他の運用業務に関連して、取引が制限されることもあります。したがって、これらの制限により当ファンドの運用実績に影響を及ぼす可能性があります。
- ・法令・税制・会計方針などの変更に関する事項
ファンドに適用される法令・税制・会計方針などは、今後変更される場合があります。

（２）リスク管理体制



全社的リスク管理

当社では運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理/コンプライアンス業務担当部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。当社グループの法令などの遵守状況についてはコンプライアンス部門が事務局を務めるコンプライアンス監督委員会、リスク管理状況についてはリスク管理部門が事務局を務めるリスク監督委員会を通して経営陣に報告され、更に年一度以上取締役会に対して全体的な活動状況を報告しております。両委員会およびそれに関連する部門別会議においては、法令遵守状況や各種リスク（運用リスク（流動性リスクを含む）、市場リスク、カウンターパーティーリスク、オペレーショナルリスク（事務リスクを含む）など）に関するモニタリングとその報告に加えて、重要事故への対応と各種リスク対応、事故防止のための施策やその管理手法の構築などの支援に努めております。

運用状況の評価・分析および運用リスク管理

ファンド財産について運用状況の評価・分析および運用リスク（流動性リスクを含む）の管理状況をモニタリングします。運用パフォーマンスおよび運用リスクに係る評価と分析の結果については運用リスク会議に報告し、運用リスク（流動性リスクを含む）の管理状況についてはリスク監督委員会へ報告され、問題点の原因の究明や改善策の策定が図られます。加えて外部委託運用部門は、外部委託ファンドの運用管理を行な

い、投資方針に沿った運用が行なわれているかなどのモニタリングを行なっています。

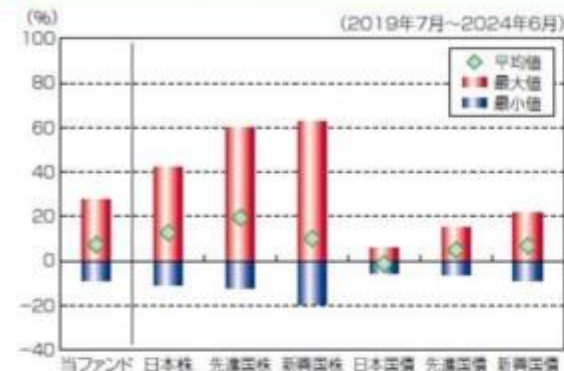
法令など遵守状況のモニタリング

運用における法令・諸規則、信託約款などの遵守状況については、コンプライアンス業務担当部門が管理を行ないます。問題点についてはコンプライアンス関連の委員会に報告され、必要に応じ運用部門に対し是正指導が行なわれるなど、適切に管理・監督を行ないます。

上記体制は2024年6月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

（参考情報）

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



（当ファンドと他の代表的な資産クラスの平均騰落率、年間最大騰落率および最小騰落率(%)）

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	7.3%	12.7%	19.5%	10.0%	-1.2%	4.9%	6.7%
最大値	27.4%	42.1%	59.8%	62.7%	5.4%	15.3%	21.5%
最小値	-8.7%	-10.8%	-12.4%	-19.4%	-5.5%	-6.1%	-8.8%

※上記は当ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

※全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※上記は2019年7月から2024年6月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の最大・最小・平均を、当ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。当ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

<各資産クラスの指数>

日本株 ……TOPIX(東証株価指数)配当込み

先進国株 ……MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、円ベース)

新興国株 ……MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

※上記各指数の著作権等の知的財産権その他一切の権利は、各指数の算出元または公表元に帰属します。

当ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。

※分配金再投資基準価額は、2019年7月末の基準価額を起点として指数化しています。

※当ファンドの分配金再投資基準価額および年間騰落率(各月末における直近1年間の騰落率)は、分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものであり、実際の基準価額および実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

TOPIX(東証株価指数)配当込み

当指数は、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利は株式会社J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社に帰属します。

MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、円ベース)

当指数は、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)

当指数は、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、当指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。

NOMURA-BPI国債

当指数は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社(以下「NFRIC」)が公表している指数で、その知的財産権はNFRICに帰属します。なお、NFRICは、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる日興アセットマネジメント株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

当指数は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。当指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

JPモルガンGBI-EMグローバル・ディバーシファイド(円ヘッジなし、円ベース)

当指数は、J.P. Morgan Securities LLCが算出、公表している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。なお、当指数に関する著作権等の知的財産権その他一切の権利は、J.P. Morgan Securities

LLCに帰属します。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

販売会社が定めるものとし、申込手数料率につきましては、販売会社の照会先にお問い合わせください。

- ・販売会社における申込手数料率は3.3%（税抜3%）が上限となっております。
 - ・申込手数料の額（1口当たり）は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に申込手数料率を乗じて得た額とします。
 - ・＜分配金再投資コース＞の場合、収益分配金の再投資により取得する口数については、申込手数料はかかりません。
 - ・販売会社によっては、償還乗換、乗換優遇の適用を受けることができる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- 申込手数料は、商品および関連する投資環境の説明や情報提供など、ならびに購入に関する事務コストの対価です。

(2)【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.2%の率を乗じて得た額（1口当たり）が差し引かれます。

「信託財産留保額」とは、投資信託を解約される受益者の解約代金から差し引いて、信託財産に繰り入れる金額のことで、

(3)【信託報酬等】

信託報酬

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年1.045%（税抜0.95%）の率を乗じて得た額とします。

この他に、投資対象とする「日本リートインデックス」-REITマザーファンド」および「海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド」の主要投資対象である不動産投信には運用などに係る費用がかかりますが、投資する不動産投信の銘柄は固定されていないため、事前に料率、上限額などを表示することができません。

信託報酬の配分

信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率			
合計	委託会社	販売会社	受託会社
0.95%	0.40%	0.50%	0.05%

委託会社	委託した資金の運用の対価
販売会社	運用報告書など各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供などの対価
受託会社	運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

支払時期

信託報酬（信託報酬に係る消費税等相当額を含みます。）は、日々計上され、毎計算期末または信託終了のときに、信託財産から支払います。

(4)【その他の手数料等】

以下の諸費用およびそれに付随する消費税等相当額について、委託会社は、その支払いをファンドのために行ない、ファンドの日々の純資産総額に対して年率0.1%を乗じた額の信託期間を通じた合計を上限として、支払金額の支弁を信託財産から受けることができます。（以下「実費方式」といいます。）また、実際に支払う金額の支弁を受ける代わりに、その金額をあらかじめ合理的に見積もった上で、見積額に基づいて見積率を算出し、かかる見積率を信託財産の純資産総額に乘じて得た額をかかる諸費用の合計額とみなして、信託財産から支弁を受けることができます。（以下「見積方式」といいます。）ただし、委託会社は、信託財産の規模などを考慮して、信託の設定時または期中に、かかる諸費用の見積率を見直し、年率0.1%を上限として、これを変更することができます。委託会社は、実費方式または見積方式のいずれを用いるかについて、信託期間を通じて随時、見直すことができます。これら諸費用は、委託会社が定めた時期に、信託財産から支払います。

やむを得ない事情などにより受益証券を発行する場合における発行および管理事務に係る費用。

有価証券届出書、有価証券報告書および臨時報告書（これらの訂正に係る書類を含みます。）の作成、印刷および提出に係る費用。

目論見書および仮目論見書（これらの訂正事項分を含みます。）の作成、印刷および交付に係る費用（これらを監督官庁に提出する場合の提出費用も含みます。）。

信託約款の作成、印刷および交付に係る費用（これを監督官庁に提出する場合の提出費用も含みます。）

す。)。運用報告書の作成、印刷および交付に係る費用(これを監督官庁に提出する場合の提出費用も含みます。)。ファンドの受益者に対して行なう公告に係る費用ならびに信託約款の変更または信託契約の解約に係る事項を記載した書面の作成、印刷および交付に係る費用。格付の取得に要する費用。ファンドの監査人、法律顧問および税務顧問に対する報酬および費用。ファンドの主要投資対象の1つである「日本リートインデックス」-REITマザーファンド」の運用の基本方針に規定する「東証REIT指数(配当込み)」その他これに類する標章の使用料。ファンドの主要投資対象の1つである「海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド」の運用の基本方針に規定する「S&P先進国REIT指数(除く日本、税引後配当込み、ヘッジなし・円ベース)」その他これに類する標章の使用料。信託財産に関する以下の費用およびそれに付随する消費税等相当額は、受益者の負担とし、信託財産から支払います。組入る有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料。信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、外貨建資産の保管などに要する費用、解約に伴う支払資金の手当てなどを目的とした借入金の利息および受託会社の立て替えた立替金の利息。

<投資対象とする投資信託証券に係る費用>

- ・組入る有価証券の売買時の売買委託手数料
- ・信託事務の処理に要する諸費用
- ・信託財産に関する租税 など

監査費用は、監査法人などに支払うファンドの監査に係る費用です。

* 売買委託手数料などは、保有期間や運用の状況などに応じて異なり、あらかじめ見積もることができないため、表示することができません。

投資家の皆様にご負担いただく手数料などの合計額については、保有期間や運用の状況などに応じて異なりますので、表示することができません。

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

- ・公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合に少額投資非課税制度(NISA)の適用対象となります。
- ・当ファンドは、NISAの対象ではありません。

個人受益者の場合

1) 収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については配当所得として、20.315%(所得税15.315%および地方税5%)の税率による源泉徴収(原則として、確定申告は不要です。)が行なわれます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税(配当控除の適用はありません。)のいずれかを選択することもできます。

2) 解約金および償還金に対する課税

解約時および償還時の差益(譲渡益)*については譲渡所得として、20.315%(所得税15.315%および地方税5%)の税率による申告分離課税の対象となり、確定申告が必要となります。なお、源泉徴収ありの特定口座(源泉徴収選択口座)を選択している場合は、20.315%(所得税15.315%および地方税5%)の税率による源泉徴収(原則として、確定申告は不要です。)が行なわれます。

* 解約価額および償還価額から取得費用(申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を含みます。)を控除した利益

確定申告等により、解約時および償還時の差損(譲渡損失)については、上場株式等の譲渡益、上場株式等の配当等および特定公社債等の利子所得(申告分離課税を選択したものに限り)と損益通算が可能です。また、解約時および償還時の差益(譲渡益)、普通分配金および特定公社債等の利子所得(申告分離課税を選択したものに限り)については、上場株式等の譲渡損失と損益通算が可能です。

法人受益者の場合

1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については配当所得として、15.315%(所得税のみ)の税率による源泉徴収が行なわれます。源泉徴収された税金は、所有期間に応じて法人税から控除される場合があります。

2) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

個別元本

1) 各受益者の買付時の基準価額(申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額は含まれません。)が個別元本になります。

2) 受益者が同一ファンドを複数回お申込みの場合、1口当たりの個別元本は、申込口数で加重平均した値となります。ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

1) 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。

2) 受益者が収益分配金を受け取る際

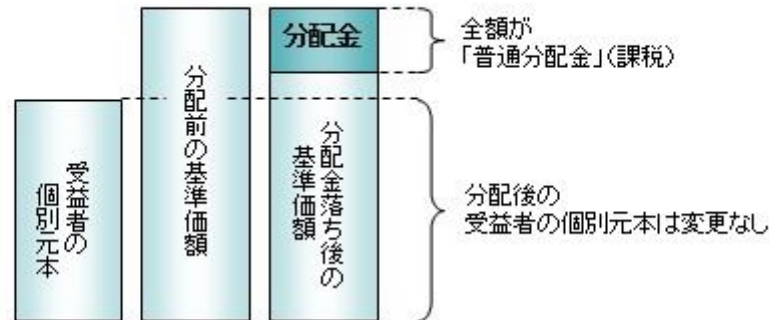
イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益

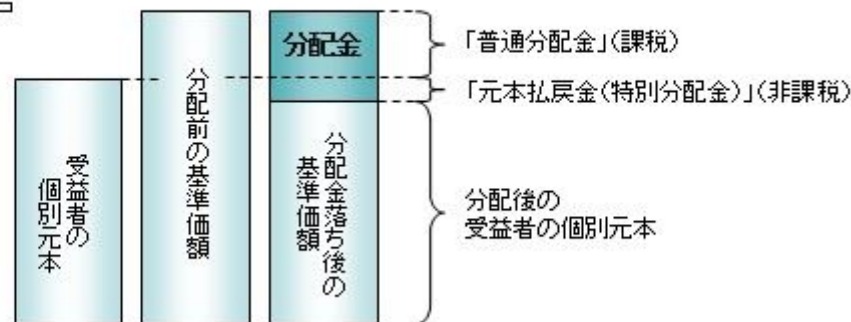
- 分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。
- ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。上記は2024年9月17日現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

(参考情報)ファンドの総経費率

対象期間:2023年12月16日~2024年6月17日

総経費率(①+②)	①運用管理費用の比率	②その他費用の比率
1.08%	1.05%	0.03%

※対象期間の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。消費税等のかかるものは消費税等を含みます。)を対象期間の平均受益権口数に平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した値(年率)です。
 ※ファンド(実質的な保有も含みます)がREIT(不動産投資信託)等に投資している場合、それらの保有にかかる費用は上記には含まれておりません。
 ※これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。
 ※運用管理費用の内訳等の詳細につきましては、対象期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

5【運用状況】

【世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型】

以下の運用状況は2024年6月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	39,148,144,251	98.15
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		739,367,023	1.85
合計(純資産総額)		39,887,511,274	100.00

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI - KOKUSAI (ヘッジなし) マザーファンド	1,005,547,838	6.6771	6,714,143,470	6.8878	6,926,012,398	17.36
日本	親投資信託受益証券	海外リートインデックス(ヘッジなし) マザーファンド	1,931,418,401	3.4217	6,608,734,343	3.4970	6,754,170,148	16.93
日本	親投資信託受益証券	海外債券インデックス(ヘッジなし) マザーファンド	2,142,219,483	3.0601	6,555,405,840	3.1162	6,675,584,352	16.74
日本	親投資信託受益証券	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	2,279,629,256	2.7973	6,376,806,918	2.9142	6,643,295,577	16.66
日本	親投資信託受益証券	日本リートインデックスJ-REITマザーファンド	2,486,965,212	2.4259	6,033,128,907	2.4473	6,086,349,963	15.26
日本	親投資信託受益証券	日本債券インデックスマザーファンド	4,636,888,576	1.3173	6,108,173,321	1.3075	6,062,731,813	15.20

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	98.15
合計	98.15

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

期別	純資産総額(百万円)		1口当たり純資産額(円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第19特定期間末 (2014年12月15日)	52,113	52,176	0.8237	0.8247
第20特定期間末 (2015年6月15日)	48,576	48,632	0.8576	0.8586
第21特定期間末 (2015年12月15日)	42,709	42,762	0.8131	0.8141
第22特定期間末 (2016年6月15日)	39,155	39,206	0.7769	0.7779
第23特定期間末 (2016年12月15日)	39,745	39,793	0.8277	0.8287
第24特定期間末 (2017年6月15日)	36,443	36,487	0.8278	0.8288
第25特定期間末 (2017年12月15日)	34,568	34,608	0.8629	0.8639
第26特定期間末 (2018年6月15日)	32,895	32,934	0.8573	0.8583
第27特定期間末 (2018年12月17日)	31,635	31,672	0.8421	0.8431
第28特定期間末 (2019年6月17日)	31,844	31,881	0.8638	0.8648
第29特定期間末 (2019年12月16日)	32,740	32,776	0.9108	0.9118
第30特定期間末 (2020年6月15日)	29,571	29,607	0.8310	0.8320
第31特定期間末 (2020年12月15日)	31,006	31,041	0.8907	0.8917
第32特定期間末 (2021年6月15日)	34,941	34,975	1.0217	1.0227
第33特定期間末 (2021年12月15日)	36,248	36,283	1.0365	1.0375

第34特定期間末	(2022年 6月15日)	35,426	35,462	0.9906	0.9916
第35特定期間末	(2022年12月15日)	37,443	37,480	1.0208	1.0218
第36特定期間末	(2023年 6月15日)	39,363	39,400	1.0678	1.0688
第37特定期間末	(2023年12月15日)	38,974	39,009	1.0988	1.0998
第38特定期間末	(2024年 6月17日)	39,212	39,245	1.1834	1.1844
	2023年 6月末日	39,701		1.0839	
	7月末日	39,657		1.0838	
	8月末日	40,036		1.0948	
	9月末日	38,832		1.0726	
	10月末日	37,662		1.0430	
	11月末日	39,154		1.0937	
	12月末日	38,850		1.1069	
	2024年 1月末日	39,045		1.1302	
	2月末日	39,063		1.1442	
	3月末日	39,824		1.1786	
	4月末日	39,468		1.1772	
	5月末日	39,115		1.1771	
	6月末日	39,887		1.2058	

(注)分配付きの金額は、特定期間末の金額に当該特定期間末の分配金を加算した金額です。

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第19特定期間	2014年 6月17日～2014年12月15日	0.0060
第20特定期間	2014年12月16日～2015年 6月15日	0.0060
第21特定期間	2015年 6月16日～2015年12月15日	0.0060
第22特定期間	2015年12月16日～2016年 6月15日	0.0060
第23特定期間	2016年 6月16日～2016年12月15日	0.0060
第24特定期間	2016年12月16日～2017年 6月15日	0.0060
第25特定期間	2017年 6月16日～2017年12月15日	0.0060
第26特定期間	2017年12月16日～2018年 6月15日	0.0060
第27特定期間	2018年 6月16日～2018年12月17日	0.0060
第28特定期間	2018年12月18日～2019年 6月17日	0.0060
第29特定期間	2019年 6月18日～2019年12月16日	0.0060
第30特定期間	2019年12月17日～2020年 6月15日	0.0060
第31特定期間	2020年 6月16日～2020年12月15日	0.0060
第32特定期間	2020年12月16日～2021年 6月15日	0.0060
第33特定期間	2021年 6月16日～2021年12月15日	0.0060
第34特定期間	2021年12月16日～2022年 6月15日	0.0060
第35特定期間	2022年 6月16日～2022年12月15日	0.0060
第36特定期間	2022年12月16日～2023年 6月15日	0.0060
第37特定期間	2023年 6月16日～2023年12月15日	0.0060
第38特定期間	2023年12月16日～2024年 6月17日	0.0060

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第19特定期間	2014年 6月17日～2014年12月15日	13.81
第20特定期間	2014年12月16日～2015年 6月15日	4.84
第21特定期間	2015年 6月16日～2015年12月15日	4.49
第22特定期間	2015年12月16日～2016年 6月15日	3.71
第23特定期間	2016年 6月16日～2016年12月15日	7.31
第24特定期間	2016年12月16日～2017年 6月15日	0.74
第25特定期間	2017年 6月16日～2017年12月15日	4.96
第26特定期間	2017年12月16日～2018年 6月15日	0.05
第27特定期間	2018年 6月16日～2018年12月17日	1.07
第28特定期間	2018年12月18日～2019年 6月17日	3.29
第29特定期間	2019年 6月18日～2019年12月16日	6.14
第30特定期間	2019年12月17日～2020年 6月15日	8.10
第31特定期間	2020年 6月16日～2020年12月15日	7.91
第32特定期間	2020年12月16日～2021年 6月15日	15.38
第33特定期間	2021年 6月16日～2021年12月15日	2.04
第34特定期間	2021年12月16日～2022年 6月15日	3.85
第35特定期間	2022年 6月16日～2022年12月15日	3.65
第36特定期間	2022年12月16日～2023年 6月15日	5.19
第37特定期間	2023年 6月16日～2023年12月15日	3.47
第38特定期間	2023年12月16日～2024年 6月17日	8.25

(注)各特定期間の収益率は、特定期間末の基準価額（分配落ち）に当該特定期間の分配金を加算し、当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（分配落ち。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。

(4) 【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第19特定期間	2014年 6月17日～2014年12月15日	848,123,250	9,300,633,130
第20特定期間	2014年12月16日～2015年 6月15日	1,077,889,968	7,702,577,651
第21特定期間	2015年 6月16日～2015年12月15日	822,766,387	4,936,873,357
第22特定期間	2015年12月16日～2016年 6月15日	559,222,913	2,691,021,175
第23特定期間	2016年 6月16日～2016年12月15日	788,561,373	3,167,580,874
第24特定期間	2016年12月16日～2017年 6月15日	535,316,706	4,530,717,126
第25特定期間	2017年 6月16日～2017年12月15日	675,282,245	4,636,099,733
第26特定期間	2017年12月16日～2018年 6月15日	900,474,282	2,591,559,940
第27特定期間	2018年 6月16日～2018年12月17日	1,657,593,437	2,463,297,514
第28特定期間	2018年12月18日～2019年 6月17日	1,553,018,779	2,252,941,131
第29特定期間	2019年 6月18日～2019年12月16日	1,375,802,750	2,295,826,563
第30特定期間	2019年12月17日～2020年 6月15日	1,727,094,985	2,087,383,750
第31特定期間	2020年 6月16日～2020年12月15日	1,154,110,398	1,927,320,256
第32特定期間	2020年12月16日～2021年 6月15日	2,277,192,099	2,890,774,812
第33特定期間	2021年 6月16日～2021年12月15日	2,642,144,579	1,866,998,446

第34特定期間	2021年12月16日～2022年 6月15日	2,197,942,225	1,407,308,080
第35特定期間	2022年 6月16日～2022年12月15日	2,127,865,577	1,212,529,506
第36特定期間	2022年12月16日～2023年 6月15日	1,533,696,702	1,347,087,591
第37特定期間	2023年 6月16日～2023年12月15日	1,301,936,668	2,696,216,303
第38特定期間	2023年12月16日～2024年 6月17日	403,069,289	2,740,137,738

(参考)

日本リートインデックスJ - R E I Tマザーファンド

以下の運用状況は2024年 6月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	日本	59,927,146,550	98.93
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		646,286,632	1.07
合計(純資産総額)		60,573,433,182	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人 投資証券	7,082	579,000	4,100,478,000	563,000	3,987,166,000	6.58
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	6,236	507,000	3,161,652,000	508,000	3,167,888,000	5.23
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	19,631	140,300	2,754,229,300	142,700	2,801,343,700	4.62
日本	投資証券	KDX不動産投資法人 投資証券	17,202	152,500	2,623,305,000	156,500	2,692,113,000	4.44
日本	投資証券	GLP投資法人 投資証券	20,391	129,900	2,648,790,900	131,300	2,677,338,300	4.42
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	10,575	250,100	2,644,807,500	251,000	2,654,325,000	4.38
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人 投資証券	29,098	89,800	2,613,000,400	90,500	2,633,369,000	4.35
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人 投資証券	9,151	244,700	2,239,249,700	245,800	2,249,315,800	3.71
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	5,956	320,000	1,905,920,000	327,500	1,950,590,000	3.22
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	13,580	142,200	1,931,076,000	142,900	1,940,582,000	3.20
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人 投資証券	12,096	157,600	1,906,329,600	159,200	1,925,683,200	3.18
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人 投資証券	29,393	67,900	1,995,784,700	65,200	1,916,423,600	3.16
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	20,322	78,900	1,603,405,800	77,700	1,579,019,400	2.61
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	18,242	77,400	1,411,930,800	79,100	1,442,942,200	2.38
日本	投資証券	産業ファンド投資法人 投資証券	11,057	122,100	1,350,059,700	126,600	1,399,816,200	2.31
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	4,152	327,000	1,357,704,000	324,000	1,345,248,000	2.22
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	2,096	640,000	1,341,440,000	639,000	1,339,344,000	2.21

日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人 投資証券	7,760	146,800	1,139,168,000	147,600	1,145,376,000	1.89
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人 投資証券	3,124	366,500	1,144,946,000	365,000	1,140,260,000	1.88
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	2,525	431,000	1,088,275,000	433,500	1,094,587,500	1.81
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	3,875	265,400	1,028,425,000	266,000	1,030,750,000	1.70
日本	投資証券	イオンリート投資法人 投資証券	7,447	131,700	980,769,900	133,200	991,940,400	1.64
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人 投資証券	2,252	445,000	1,002,140,000	439,500	989,754,000	1.63
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	2,985	314,500	938,782,500	318,000	949,230,000	1.57
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人 投資証券	7,139	129,900	927,356,100	131,600	939,492,400	1.55
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人 投資証券	8,940	102,900	919,926,000	105,000	938,700,000	1.55
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人 投資証券	5,680	143,700	816,216,000	146,000	829,280,000	1.37
日本	投資証券	森トラストリート投資法人 投資証券	11,701	68,700	803,858,700	69,400	812,049,400	1.34
日本	投資証券	三菱地所物流リート投資法人 投資証券	2,096	375,500	787,048,000	381,000	798,576,000	1.32
日本	投資証券	N T T都市開発リート投資法人 投資証券	6,155	115,800	712,749,000	116,300	715,826,500	1.18

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	98.93
合計	98.93

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド

以下の運用状況は2024年 6月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	アメリカ	44,681,971,898	77.56
	カナダ	795,681,905	1.38
	ドイツ	22,739,750	0.04
	イタリア	5,243,652	0.01
	フランス	1,007,509,503	1.75
	オランダ	101,520,734	0.18
	スペイン	244,013,874	0.42
	ベルギー	595,131,389	1.03
	アイルランド	20,316,144	0.04
	イギリス	2,768,960,463	4.81
	オーストラリア	4,251,341,912	7.38

	ニュージーランド	69,651,800	0.12
	香港	495,764,365	0.86
	シンガポール	1,766,685,873	3.07
	韓国	112,606,485	0.20
	イスラエル	61,855,561	0.11
	ガーンジー	133,974,183	0.23
	小計	57,134,969,491	99.18
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		471,480,287	0.82
合計(純資産総額)		57,606,449,778	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	244,366	18,086.55	4,419,737,951	17,935.14	4,382,739,521	7.61
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	25,059	123,420.80	3,092,801,978	121,118.19	3,035,100,904	5.27
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	157,897	16,739.54	2,643,123,798	16,646.58	2,628,445,753	4.56
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	86,040	23,972.04	2,062,555,018	24,129.89	2,076,136,312	3.60
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	85,693	24,147.61	2,069,281,521	23,954.33	2,052,718,435	3.56
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	230,125	8,595.27	1,977,987,138	8,444.90	1,943,382,635	3.37
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	41,752	45,623.07	1,904,854,732	46,154.60	1,927,047,214	3.35
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	456,430	3,827.39	1,746,935,618	3,689.36	1,683,934,585	2.92
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	55,895	25,218.72	1,409,600,907	25,085.04	1,402,128,411	2.43
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	276,008	4,556.61	1,257,663,159	4,579.22	1,263,901,381	2.19
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	37,500	32,518.42	1,219,440,836	33,228.74	1,246,077,787	2.16
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	77,393	14,177.38	1,097,230,078	14,369.05	1,112,064,250	1.93
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL-REIT	91,112	10,744.97	978,996,590	11,002.69	1,002,477,246	1.74
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	107,054	8,069.60	863,883,708	8,183.96	876,126,371	1.52
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	151,960	5,717.98	868,905,001	5,692.21	864,988,809	1.50
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	41,527	18,735.66	778,035,852	18,746.93	778,504,065	1.35
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	16,961	44,857.99	760,836,453	44,033.31	746,849,083	1.30
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	30,849	22,440.27	692,259,963	22,636.77	698,321,958	1.21
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	353,108	1,849.63	653,120,280	1,817.48	641,767,913	1.11
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	32,937	18,787.20	618,794,165	19,338.06	636,937,821	1.11
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	185,867	3,165.02	588,273,795	3,098.98	575,999,380	1.00
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	176,127	3,020.06	531,914,548	3,074.82	541,559,932	0.94
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	186,306	2,870.26	534,748,038	2,902.48	540,749,700	0.94
アメリカ	投資証券	UDR INC	80,031	6,487.89	519,233,092	6,566.82	525,549,483	0.91
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	49,405	10,102.31	499,104,645	10,511.42	519,317,110	0.90
アメリカ	投資証券	MP CAREY INC	57,840	9,034.41	522,550,639	8,963.54	518,451,472	0.90
アメリカ	投資証券	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	71,895	6,993.59	502,804,290	7,198.21	517,515,905	0.90
アメリカ	投資証券	AMERICAN HOMES 4 RENT- A	85,105	5,709.21	485,882,873	5,920.93	503,901,020	0.87
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	28,132	17,402.00	489,553,143	17,675.82	497,256,219	0.86
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	1,377,841	333.83	459,978,439	332.76	458,504,149	0.80

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	99.18
合計	99.18

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

日本債券インデックスマザーファンド

以下の運用状況は2024年 6月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	48,913,099,700	89.49
地方債証券	日本	1,820,156,691	3.33
特殊債券	日本	2,093,773,088	3.83
社債券	日本	1,713,166,395	3.13
コール・ローン等、その他資産(負債控除後)		118,551,308	0.22
合計(純資産総額)		54,658,747,182	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第341回利付国債(10年)	700,000,000	100.47	703,297,000	100.10	700,714,000	0.300	2025/12/20	1.28
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	700,000,000	99.87	699,090,000	99.48	696,367,000	0.100	2026/9/20	1.27
日本	国債証券	第347回利付国債(10年)	680,000,000	99.54	676,919,600	99.16	674,308,400	0.100	2027/6/20	1.23
日本	国債証券	第345回利付国債(10年)	660,000,000	99.78	658,548,000	99.39	656,033,400	0.100	2026/12/20	1.20
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	660,000,000	99.67	657,881,400	99.28	655,287,600	0.100	2027/3/20	1.20
日本	国債証券	第343回利付国債(10年)	645,000,000	99.94	644,658,150	99.55	642,155,550	0.100	2026/6/20	1.17
日本	国債証券	第342回利付国債(10年)	630,000,000	100.00	630,000,000	99.69	628,059,600	0.100	2026/3/20	1.15
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	620,000,000	100.65	624,054,800	100.24	621,543,800	0.400	2025/9/20	1.14
日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	590,000,000	99.24	585,521,900	98.88	583,439,200	0.100	2027/12/20	1.07
日本	国債証券	第358回利付国債(10年)	590,000,000	97.34	574,306,000	97.07	572,736,600	0.100	2030/3/20	1.05
日本	国債証券	第360回利付国債(10年)	580,000,000	96.68	560,784,600	96.56	560,082,800	0.100	2030/9/20	1.02
日本	国債証券	第357回利付国債(10年)	560,000,000	97.61	546,638,400	97.29	544,874,400	0.100	2029/12/20	1.00

日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	540,000,000	99.06	534,967,200	98.72	533,088,000	0.100	2028/3/20	0.98
日本	国債証券	第351回利付国債(10年)	535,000,000	98.87	529,002,650	98.53	527,178,300	0.100	2028/6/20	0.96
日本	国債証券	第352回利付国債(10年)	520,000,000	98.67	513,120,400	98.32	511,290,000	0.100	2028/9/20	0.94
日本	国債証券	第348回利付国債(10年)	500,000,000	99.40	497,005,000	99.04	495,225,000	0.100	2027/9/20	0.91
日本	国債証券	第372回利付国債(10年)	500,000,000	101.12	505,611,000	98.51	492,595,000	0.800	2033/9/20	0.90
日本	国債証券	第363回利付国債(10年)	500,000,000	95.57	477,875,000	95.66	478,310,000	0.100	2031/6/20	0.88
日本	国債証券	第364回利付国債(10年)	500,000,000	95.18	475,940,000	95.31	476,590,000	0.100	2031/9/20	0.87
日本	国債証券	第369回利付国債(10年)	490,000,000	97.43	477,418,100	96.85	474,569,900	0.500	2032/12/20	0.87
日本	国債証券	第366回利付国債(10年)	480,000,000	95.67	459,225,600	95.39	457,896,000	0.200	2032/3/20	0.84
日本	国債証券	第371回利付国債(10年)	480,000,000	96.49	463,182,700	95.37	457,800,000	0.400	2033/6/20	0.84
日本	国債証券	第361回利付国債(10年)	460,000,000	96.30	443,016,800	96.28	442,911,000	0.100	2030/12/20	0.81
日本	国債証券	第368回利付国債(10年)	450,000,000	95.06	427,781,400	94.74	426,370,500	0.200	2032/9/20	0.78
日本	国債証券	第373回利付国債(10年)	440,000,000	98.23	432,217,700	96.41	424,221,600	0.600	2033/12/20	0.78
日本	国債証券	第359回利付国債(10年)	420,000,000	97.02	407,488,200	96.83	406,723,800	0.100	2030/6/20	0.74
日本	国債証券	第370回利付国債(10年)	420,000,000	96.87	406,854,000	96.57	405,598,200	0.500	2033/3/20	0.74
日本	国債証券	第367回利付国債(10年)	420,000,000	95.37	400,583,400	95.07	399,323,400	0.200	2032/6/20	0.73
日本	国債証券	第353回利付国債(10年)	400,000,000	98.48	393,944,000	98.05	392,228,000	0.100	2028/12/20	0.72
日本	国債証券	第365回利付国債(10年)	410,000,000	95.19	390,290,800	94.99	389,491,800	0.100	2031/12/20	0.71

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	89.49
地方債証券	3.33
特殊債券	3.83
社債券	3.13
合計	99.78

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド

以下の運用状況は2024年6月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	81,225,430,169	46.90

カナダ	3,475,275,437	2.01
メキシコ	1,342,192,846	0.77
ドイツ	10,541,655,040	6.09
イタリア	12,075,248,484	6.97
フランス	12,982,366,245	7.50
オランダ	2,517,527,377	1.45
スペイン	7,986,060,017	4.61
ベルギー	2,933,803,987	1.69
オーストリア	1,978,476,805	1.14
フィンランド	920,124,473	0.53
アイルランド	851,278,745	0.49
イギリス	9,007,280,707	5.20
スウェーデン	284,187,817	0.16
ノルウェー	280,418,365	0.16
デンマーク	442,026,949	0.26
ポーランド	927,247,317	0.54
オーストラリア	2,206,095,086	1.27
ニュージーランド	422,769,524	0.24
シンガポール	715,699,525	0.41
マレーシア	848,903,707	0.49
中国	17,098,053,246	9.87
イスラエル	531,995,200	0.31
小計	171,594,117,068	99.08
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）	1,593,653,328	0.92
合計（純資産総額）	173,187,770,396	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	売建		64,388,760	0.04

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	利率（％）	償還期限	投資比率（％）
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,750,000	15,575.96	1,051,377,861	15,779.81	1,065,137,749	3.625	2026/5/15	0.62
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,190,000	13,472.61	968,681,350	14,179.18	1,019,483,429	1.750	2029/11/15	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,110,000	15,131.76	924,551,115	15,920.43	972,738,433	4.125	2032/11/15	0.56
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,950,000	15,575.34	926,732,739	15,960.07	949,624,281	4.125	2028/7/31	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,540,000	16,464.24	912,119,342	16,357.39	906,199,928	4.500	2033/11/15	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,530,000	12,321.85	804,617,132	13,162.43	859,506,745	1.375	2031/11/15	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,950,000	13,603.97	809,436,346	14,213.78	845,720,102	0.375	2027/7/31	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,020,000	12,784.12	769,604,379	13,574.22	817,168,199	1.625	2031/5/15	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	16,054.13	802,706,841	16,096.61	804,830,549	5.000	2025/8/31	0.46

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	16,140.01	807,000,968	16,062.94	803,147,368	4.250	2029/2/28	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,870,000	12,759.96	749,009,969	13,589.63	797,711,690	1.875	2032/2/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	15,526.89	776,344,514	15,768.02	788,401,409	3.000	2025/7/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	15,516.82	775,841,170	15,765.45	788,272,553	2.875	2025/6/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,000,000	15,197.82	759,891,214	15,552.67	777,633,880	3.250	2027/6/30	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,900,000	15,213.56	745,464,480	15,847.77	776,540,923	4.000	2030/7/31	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,910,000	12,266.47	724,948,917	13,074.97	772,730,727	0.875	2030/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,980,000	14,739.16	734,010,235	15,334.36	763,651,293	3.250	2029/6/30	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,700,000	16,032.74	753,539,096	16,097.56	756,585,381	4.500	2027/5/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,730,000	15,227.71	720,271,103	15,575.34	736,713,589	2.000	2025/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,840,000	14,807.10	716,663,673	15,206.63	736,001,125	1.625	2026/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,100,000	13,584.61	692,815,190	14,408.83	734,850,788	2.750	2032/8/15	0.42
中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	32,000,000	2,247.43	719,180,486	2,256.46	722,069,512	3.020	2025/10/22	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,810,000	14,105.57	678,478,224	14,737.90	708,893,230	2.375	2029/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,930,000	13,627.39	671,830,415	14,277.01	703,857,052	1.500	2028/11/30	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,800,000	13,781.55	661,514,490	14,586.57	700,155,827	2.875	2032/5/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,490,000	15,202.30	682,583,631	15,418.66	692,298,164	2.250	2026/3/31	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,590,000	14,373.91	659,762,883	14,957.16	686,534,084	2.625	2029/2/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,630,000	14,132.94	654,355,224	14,760.22	683,398,617	2.375	2029/3/31	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,190,000	12,296.08	638,166,749	13,129.39	681,415,629	1.250	2031/8/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,200,000	15,472.78	649,857,049	15,715.02	660,030,842	3.000	2025/9/30	0.38

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	99.08
合計	99.08

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等 (円)	評価額 (円)	投資比率 (%)
為替予約取引	米ドル	売建	400,000.00	64,372,000	64,388,760	0.04

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

日本株式インデックストップIXマザーファンド

以下の運用状況は2024年 6月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	61,204,414,060	98.59
コール・ローン等、その他資産 (負債控除後)		878,292,647	1.41
合計 (純資産総額)		62,082,706,707	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	買建	日本	899,360,000	1.45

(注)先物取引は、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	824,800	2,610.67	2,153,280,616	3,290.00	2,713,592,000	4.37
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	930,600	1,234.53	1,148,858,468	1,729.00	1,609,007,400	2.59
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	108,600	12,277.13	1,333,297,200	13,640.00	1,481,304,000	2.39
日本	株式	日立製作所	電気機器	376,500	1,776.68	668,923,590	3,601.00	1,355,776,500	2.18
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	106,900	7,149.12	764,241,980	10,725.00	1,146,502,500	1.85
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	32,700	19,705.13	644,358,060	34,900.00	1,141,230,000	1.84
日本	株式	キーエンス	電気機器	15,500	52,894.71	819,868,056	70,550.00	1,093,525,000	1.76
日本	株式	三菱商事	卸売業	315,100	2,323.80	732,231,999	3,148.00	991,934,800	1.60
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	114,800	4,308.56	494,623,454	8,607.00	988,083,600	1.59
日本	株式	三井物産	卸売業	245,800	2,685.24	660,034,357	3,651.00	897,415,800	1.45
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	149,200	3,376.63	503,794,550	6,005.00	895,946,000	1.44
日本	株式	信越化学工業	化学	139,300	4,303.00	599,409,234	6,238.00	868,953,400	1.40
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	110,200	5,388.40	593,802,371	7,854.00	865,510,800	1.39
日本	株式	任天堂	その他製品	97,900	6,177.35	604,763,121	8,556.00	837,632,400	1.35
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	76,700	6,109.79	468,621,343	10,390.00	796,913,000	1.28
日本	株式	第一三共	医薬品	135,500	4,051.14	548,930,815	5,524.00	748,502,000	1.21
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	4,626,800	173.18	801,313,645	151.80	702,348,240	1.13
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	206,200	2,513.00	518,181,226	3,358.00	692,419,600	1.12
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	367,600	1,593.52	585,780,980	1,720.00	632,272,000	1.02
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	137,600	4,337.10	596,785,786	4,172.00	574,067,200	0.92
日本	株式	HOYA	精密機器	30,500	14,559.28	444,058,185	18,705.00	570,502,500	0.92
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	248,400	1,687.77	419,243,527	1,964.50	487,981,800	0.79
日本	株式	KDDI	情報・通信業	114,500	4,455.43	510,146,735	4,254.00	487,083,000	0.78
日本	株式	三菱重工業	機械	273,900	788.37	215,936,030	1,723.00	471,929,700	0.76
日本	株式	村田製作所	電気機器	138,700	2,507.54	347,795,798	3,322.00	460,761,400	0.74
日本	株式	ディスコ	機械	7,500	27,399.54	205,496,586	61,040.00	457,800,000	0.74
日本	株式	三菱電機	電気機器	171,700	1,748.24	300,172,808	2,567.50	440,839,750	0.71
日本	株式	ダイキン工業	機械	18,700	21,220.23	396,818,430	22,370.00	418,319,000	0.67
日本	株式	丸紅	卸売業	136,100	2,199.75	299,386,139	2,975.50	404,965,550	0.65
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	92,800	3,479.12	322,862,871	4,348.00	403,494,400	0.65

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.08
		鉱業	0.33

建設業	1.98
食料品	3.01
繊維製品	0.36
パルプ・紙	0.14
化学	5.54
医薬品	4.30
石油・石炭製品	0.54
ゴム製品	0.63
ガラス・土石製品	0.65
鉄鋼	0.86
非鉄金属	0.76
金属製品	0.50
機械	5.64
電気機器	17.52
輸送用機器	8.21
精密機器	2.19
その他製品	2.41
電気・ガス業	1.43
陸運業	2.20
海運業	0.73
空運業	0.36
倉庫・運輸関連業	0.14
情報・通信業	6.95
卸売業	7.51
小売業	3.93
銀行業	8.05
証券、商品先物取引業	0.92
保険業	3.18
その他金融業	1.17
不動産業	1.89
サービス業	4.47
合 計	98.59

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物 2024年09月	買建	32	日本円	884,797,600	899,360,000	1.45

(注)先物取引は、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

海外株式インデックスMSCI - KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド

以下の運用状況は2024年 6月28日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	315,478,094,763	71.27
	カナダ	13,573,216,228	3.07
	ドイツ	9,780,417,520	2.21
	イタリア	2,327,001,729	0.53
	フランス	11,816,668,954	2.67
	オランダ	8,515,910,197	1.92
	スペイン	2,976,113,718	0.67
	ベルギー	858,212,654	0.19
	オーストリア	209,476,968	0.05
	ルクセンブルク	172,797,631	0.04
	フィンランド	1,143,280,566	0.26
	アイルランド	7,600,105,898	1.72
	ポルトガル	174,087,857	0.04
	イギリス	16,012,988,355	3.62
	スイス	12,677,305,288	2.86
	スウェーデン	3,631,404,583	0.82
	ノルウェー	683,260,567	0.15
	デンマーク	4,574,305,139	1.03
	ケイマン	503,849,817	0.11
	オーストラリア	7,753,545,914	1.75
	バミューダ	454,813,260	0.10
	ニュージーランド	278,275,766	0.06
	香港	1,689,170,610	0.38
	シンガポール	1,222,818,233	0.28
	イスラエル	848,806,176	0.19
	ジャージー	983,119,936	0.22
	アラブ首長国連邦	0	0.00
マン島	32,091,205	0.01	
小計		425,971,139,532	96.24
投資証券	アメリカ	6,776,501,329	1.53
	カナダ	14,630,532	0.00
	フランス	144,577,267	0.03
	ベルギー	33,782,332	0.01
	イギリス	152,921,395	0.03
	オーストラリア	494,173,539	0.11
	香港	64,464,624	0.01
	シンガポール	90,025,315	0.02
小計		7,771,076,333	1.76
コール・ローン等、その他資産（負債控除後）		8,883,228,895	2.01

合計(純資産総額)	442,625,444,760	100.00
-----------	-----------------	--------

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	8,039,647,980	1.82
	買建	ドイツ	1,404,248,238	0.32

(注)先物取引は、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		8,454,892,940	1.91
	売建		44,309,641	0.01

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	303,654	55,554.48	16,869,340,327	72,940.54	22,148,689,618	5.00
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	631,054	27,711.87	17,487,689,429	34,485.08	21,761,952,092	4.92
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	1,075,440	7,232.98	7,778,640,008	19,971.06	21,477,686,768	4.85
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	402,810	20,141.41	8,113,163,613	31,867.69	12,836,628,036	2.90
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	94,530	49,633.51	4,691,855,992	83,685.52	7,910,793,075	1.79
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	254,510	20,473.74	5,210,771,925	29,863.98	7,600,683,764	1.72
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	219,630	20,581.40	4,520,294,573	30,097.54	6,610,322,754	1.49
アメリカ	株式	ELI LILLY & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	34,789	96,010.21	3,340,099,448	146,419.07	5,093,773,124	1.15
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	18,940	141,762.53	2,684,982,490	255,563.32	4,840,369,398	1.09
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	123,780	22,949.39	2,840,675,769	32,080.31	3,970,901,007	0.90
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	123,425	34,107.49	4,209,717,140	31,798.43	3,924,722,383	0.89
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CLASS B	金融サービス	56,445	54,897.70	3,098,701,218	65,708.50	3,708,916,649	0.84
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	193,159	17,418.76	3,364,590,948	18,506.94	3,574,782,603	0.81
デンマーク	株式	NOVO NORDISK A/S-B	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	140,550	16,182.47	2,274,447,273	23,160.06	3,255,146,433	0.74
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	39,800	85,202.92	3,391,076,233	78,350.89	3,118,365,454	0.70
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	68,142	38,458.64	2,620,649,325	42,939.65	2,925,993,719	0.66

オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	17,202	98,862.35	1,700,630,292	165,436.80	2,845,843,834	0.64
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	101,419	24,329.38	2,467,461,888	26,837.48	2,721,830,729	0.61
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	19,109	90,538.53	1,730,100,911	137,009.36	2,618,111,925	0.59
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	金融サービス	35,870	62,744.74	2,250,653,883	71,313.74	2,558,023,943	0.58
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	103,821	24,450.34	2,538,459,653	23,484.00	2,438,132,987	0.55
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費財・サービス流通・小売り	42,705	45,850.51	1,958,046,073	55,003.79	2,348,937,036	0.53
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	109,133	16,878.34	1,841,984,308	20,910.10	2,281,982,751	0.52
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	190,236	8,777.75	1,669,844,176	10,933.43	2,079,932,294	0.47
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	76,316	23,615.46	1,802,238,106	27,219.21	2,077,261,940	0.47
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	18,680	67,230.43	1,255,864,463	110,226.64	2,059,033,706	0.47
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	306,079	4,204.99	1,287,059,971	6,321.99	1,935,030,673	0.44
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	76,331	25,067.30	1,913,412,424	25,178.46	1,921,897,213	0.43
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	115,080	17,622.68	2,028,018,975	16,499.50	1,898,763,588	0.43
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	176,562	9,082.21	1,603,573,967	10,293.98	1,817,526,350	0.41

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	エネルギー	4.35
		素材	3.51
		資本財	6.68
		商業・専門サービス	1.52
		運輸	1.55
		自動車・自動車部品	1.54
		耐久消費財・アパレル	1.31
		消費者サービス	1.84
		メディア・娯楽	6.73
		一般消費財・サービス流通・小売り	4.88
		生活必需品流通・小売り	1.71
		食品・飲料・タバコ	3.01
		家庭用品・パーソナル用品	1.55
		ヘルスケア機器・サービス	3.96
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.83
銀行	5.29		

	金融サービス	6.25
	保険	2.88
	ソフトウェア・サービス	9.97
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.42
	電気通信サービス	1.08
	公益事業	2.46
	半導体・半導体製造装置	9.67
	不動産管理・開発	0.25
投資証券		1.76
合計		97.99

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (各通貨)	契約額等(円)	評価額 (各通貨)	評価額(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP EMINI2409	買建	180	米ドル	49,689,612.5	8,003,505,885	49,914,000	8,039,647,980	1.82
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJSTX5 2409	買建	180	ユーロ	8,153,730	1,405,132,291	8,148,600	1,404,248,238	0.32

(注)先物取引は、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	45,800,000.00	7,159,009,850	7,331,280,160	1.66
	ユーロ	買建	6,550,000.00	1,100,038,422	1,123,612,780	0.25
	加ドル	売建	116,000.00	13,615,500	13,613,690	0.00
	英ポンド	売建	81,000.00	16,475,643	16,472,160	0.00
	豪ドル	売建	133,000.00	14,221,025	14,223,791	0.00

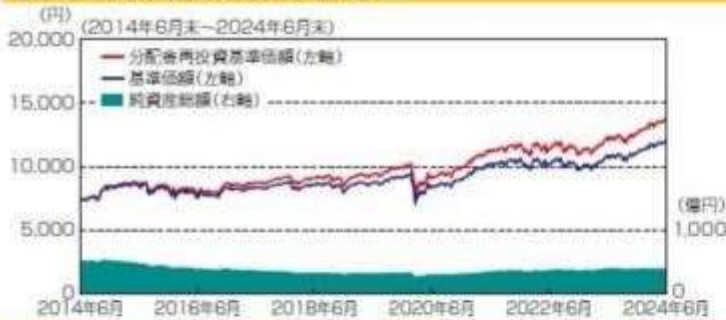
(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

参考情報

運用実績

2024年6月28日現在

基準価額・純資産の推移



基準価額…………… 12,058円

純資産総額…………… 398.87億円

※基準価額は運用管理費用(信託報酬)控除後の1万口当たりの値です。
 ※分配金再投資基準価額は、2014年6月末の基準価額を起点として指数化しています。
 ※分配金再投資基準価額は当ファンドに過去10年間、分配実績があった場合に、当該分配金(税引前)を再投資したものと計算した理論上のものである点にご留意ください。

分配の推移(税引前、1万口当たり)

2024年2月	2024年3月	2024年4月	2024年5月	2024年6月	最近1年間累計	設定来累計
10円	10円	10円	10円	10円	120円	5,480円

主要な資産の状況

組入資産	投資対象	比率*1	組入上位の銘柄名	国名	比率*2
日本リートインデックス J-REITマザーファンド	日本リート	15.3%	日本ビルファンド投資法人 投資証券	日本	6.6%
			ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	日本	5.2%
			野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	日本	4.6%
			KDX不動産投資法人 投資証券	日本	4.4%
			GLP投資法人 投資証券	日本	4.4%
海外リートインデックス (ヘッジなし)マザーファンド	海外リート	16.9%	PROLOGIS INC	アメリカ	7.6%
			EQUINIX INC	アメリカ	5.3%
			WELL TOWER INC	アメリカ	4.6%
			SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	3.6%
			DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	3.6%
日本債券インデックス マザーファンド	日本債券	15.2%	第341回利付国債(10年)	日本	1.3%
			第344回利付国債(10年)	日本	1.3%
			第347回利付国債(10年)	日本	1.2%
			第345回利付国債(10年)	日本	1.2%
			第346回利付国債(10年)	日本	1.2%
海外債券インデックス (ヘッジなし)マザーファンド	海外債券	16.7%	US TREASURY N/B(3.625%)	アメリカ	0.6%
			US TREASURY N/B(1.75%)	アメリカ	0.6%
			US TREASURY N/B(4.125%)	アメリカ	0.6%
			US TREASURY N/B(4.125%)	アメリカ	0.6%
			US TREASURY N/B(4.5%)	アメリカ	0.5%
日本株式インデックス TOPIXマザーファンド	日本株式	16.7%	トヨタ自動車	日本	4.4%
			三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	2.6%
			ソニーグループ	日本	2.4%
			日立製作所	日本	2.2%
			三井住友フィナンシャルグループ	日本	1.8%
海外株式インデックス MSCI-KOKUSAI (ヘッジなし)マザーファンド	海外株式	17.4%	MICROSOFT CORP	アメリカ	5.0%
			APPLE INC	アメリカ	4.9%
			NVIDIA CORP	アメリカ	4.9%
			AMAZON.COM INC	アメリカ	2.9%
			META PLATFORMS INC-CLASS A	アメリカ	1.8%
現金その他		1.9%			

*1:当ファンドの対純資産総額比です。また、合計の比率が四捨五入の関係で100%にならない場合があります。

*2:各マザーファンドの対純資産総額比です。

年間収益率の推移



※ファンドの年間収益率は、分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

※当ファンドには、ベンチマークはありません。

※2024年は、2024年6月末までの騰落率です。

※ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。

※ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページで開示しています。

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

- (1) 申込方法
販売会社所定の方法でお申し込みください。
- (2) コースの選択
収益分配金の受取方法によって、＜分配金再投資コース＞と＜分配金受取りコース＞の2通りがあります。ただし、販売会社によって取扱コースは異なります。
＜分配金再投資コース＞
収益分配金を自動的に再投資するコースです。なお、販売会社によっては、収益分配金を定期的に受け取るための「定期引出契約」を結ぶことができる場合があります。
＜分配金受取りコース＞
収益分配金を再投資せず、その都度受け取るコースです。
- (3) 申込みの受付
販売会社の営業日に受け付けます。
- (4) 取扱時間
原則として、午後3時までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。
2024年11月5日以降は、原則として、午後3時30分までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とする予定です。販売会社によっては異なる場合がありますので、詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- (5) 取得申込不可日
販売会社の営業日であっても、取得申込日が下記のいずれかに該当する場合は、取得の申込みの受付は行ないません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
ニューヨーク証券取引所の休業日
ニューヨークの銀行休業日
- (6) 申込金額
取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額に、申込手数料と当該手数料に係る消費税等相当額を加算した額です。
- (7) 申込単位
販売会社の照会先にお問い合わせください。
- (8) 申込代金の支払い
取得申込者は、申込金額を販売会社が指定する日までに販売会社へお支払いください。
- (9) 受付の中止および取消
委託会社は、投資対象とする投資信託証券（マザーファンドが投資対象とする投資信託証券を含みます。）への投資ができない場合、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得の申込みの受付を中止すること、および既に受け付けた取得の申込みの受付を取り消すことができます。
金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場をいいます。
- (10) 償還乗換
・受益者は、証券投資信託の償還金額（手取額）の範囲内（単位型証券投資信託については、償還金額（手取額）とその元本額のいずれか大きい額とします。）で取得する口数に係る申込手数料を徴収されない措置の適用を受けることができる場合があります。この償還乗換優遇措置を採用するか否かの選択は販売会社に任せられておりますので、販売会社により対応が異なります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
・この措置の適用を受ける受益者は、販売会社から、償還金の支払いを受けたことを証する書類の提示を求められることがあります。
- (11) 乗換優遇
受益者は、信託期間終了日の1年前以内などの一定の要件を満たした証券投資信託を解約または買取請求により換金した際の代金をもって、換金を行なった販売会社において、取得申込みをする場合の手数料率が割引となる措置の適用を受けることができます。この乗換優遇措置を採用するか否かの選択は販売会社に任せられておりますので、販売会社により対応が異なります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

2【換金（解約）手続等】

<解約請求による換金>

- (1) 解約の受付
販売会社の営業日に受け付けます。
- (2) 取扱時間
原則として、午後3時までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。
2024年11月5日以降は、原則として、午後3時30分までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とする予定です。販売会社によっては異なる場合がありますので、詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- (3) 解約請求不可日
販売会社の営業日であっても、解約請求日が下記のいずれかに該当する場合は、解約請求の受付は行ないません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
ニューヨーク証券取引所の休業日
ニューヨークの銀行休業日
- (4) 解約制限
ファンドの規模および商品性格などに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の解約には受付時間制限および金額制限を行なう場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- (5) 解約価額
解約請求受付日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額（当該基準価額に0.2%の率を乗じて得た額）を控除した価額とします。
・基準価額につきましては、販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(6) 手取額

1口当たりの手取額は、解約価額から解約に係る所定の税金を差し引いた金額となります。税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

(7) 解約単位

1口単位

販売会社によっては、解約単位が異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

(8) 解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

(9) 受付の中止および取消

- 委託会社は、投資対象とする投資信託証券（マザーファンドが投資対象とする投資信託証券を含みます。）からの換金ができない場合、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止すること、および既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。
- 解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止当日およびその前営業日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日（この計算日が解約請求を受け付けない日であるときは、この計算日以降の最初の解約請求を受け付けることができる日とします。）に解約請求を受け付けたものとして取り扱います。

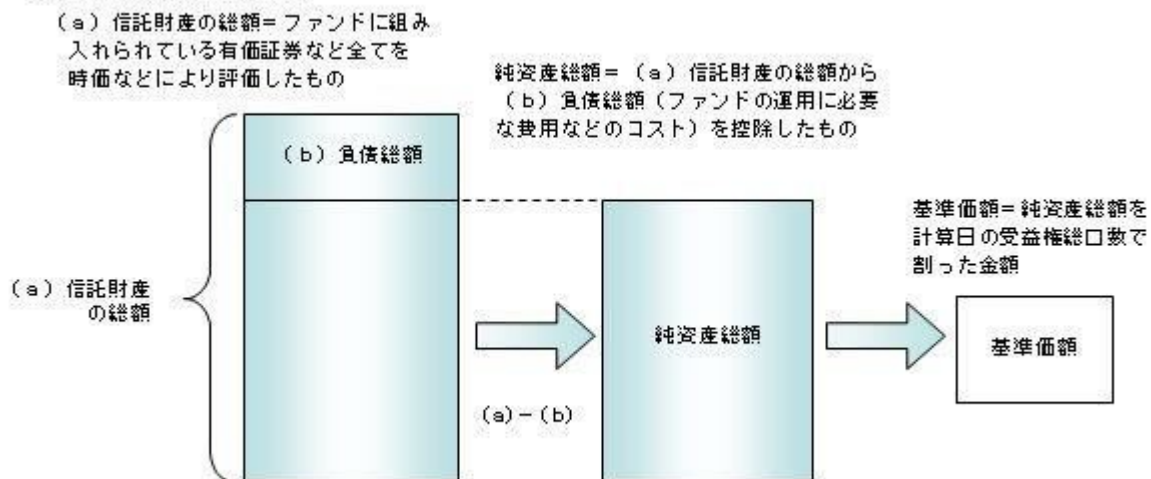
3 【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

基準価額の算出

- 基準価額は委託会社の営業日において日々算出されます。
- 基準価額とは、信託財産に属する資産を評価して得た信託財産の総額から負債総額を控除した金額（純資産総額）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。なお、ファンドは1万口当りに換算した価額で表示することがあります。

< 基準価額算出の流れ >



有価証券などの評価基準

- 信託財産に属する資産については、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価します。

< 主な資産の評価方法 >

マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式

原則として、基準価額計算日におけるわが国の金融商品取引所の最終相場で評価します。

外国株式

原則として、基準価額計算日に知りうる直近の日における外国金融商品市場の最終相場で評価します。

公社債（国内・外国）

原則として、基準価額計算日^{*}における以下のいずれかの価額で評価します。

- 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）
- 金融商品取引業者（第一種金融商品取引業者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者

に類する者をいいます。）、銀行などの提示する価額（売気配相場を除きます。）

- ・ 価格情報会社の提供する価額
残存期間1年以内の公社債などについては、一部償却原価法により評価することができます。

* 外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

国内上場不動産投信

原則として、基準価額計算日におけるわが国の金融商品取引所の最終相場で評価します。

海外上場不動産投信

原則として、基準価額計算日に知りうる直近の日における外国金融商品市場の最終相場で評価します。

- ・ 外貨建資産（外国通貨表示の有価証券、預金その他の資産をいいます。）の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客相場の仲値によって計算します。

基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

< 委託会社の照会先 >

日興アセットマネジメント株式会社

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

コールセンター 電話番号 0120-25-1404

午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

無期限とします（2005年9月29日設定）。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4) 【計算期間】

毎月16日から翌月15日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

(5) 【その他】

信託の終了（繰上償還）

- 1) 委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。

イ) 受益者の解約により受益権の口数が10億口を下回るようになった場合

ロ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき

ハ) やむを得ない事情が発生したとき

- 2) この場合、あらかじめ、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。

- 3) この繰上償還に異議のある受益者は、一定の期間内（1ヵ月以上で委託会社が定めます。以下同じ。）に異議を述べるすることができます。（後述の「異議の申立て」をご覧ください。）

- 4) 委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「異議の申立て」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。

イ) 信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、一定の期間を設けてその公告および書面の交付が困難な場合

ロ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき

ハ) 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき（監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じ、異議申立の結果、信託約款の変更が成立の場合を除きます。）

ニ) 受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき

- 5) 繰上償還を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

償還金について

- ・ 償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日（償還日が休業日の場合は翌営業日）から起算して5営業日まで）から受益者に支払います。

- ・ 償還金の支払いは、販売会社において行なわれます。

信託約款の変更

- 1) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更することができます。信託約款の変更を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

- 2) この変更事項のうち、その内容が重大なものについては、あらかじめ、その旨およびその内容などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行いません。

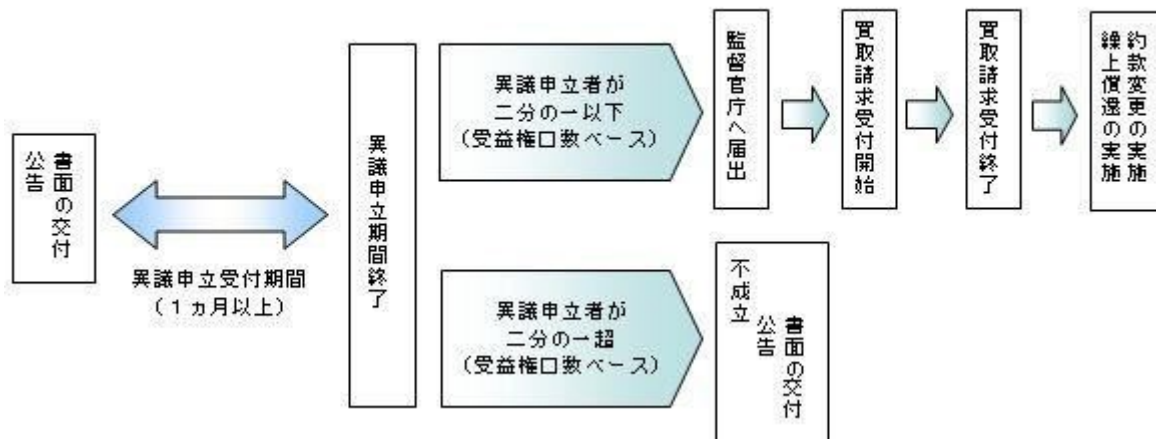
- 3) この信託約款の変更に異議のある受益者は、一定の期間内に異議を述べるすることができます。（後述の「異議の申立て」をご覧ください。）

- 4) 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、後述の「異議の申立て」の規定を適用します。

異議の申立て

- 1) 繰上償還または信託約款の重大な変更に対して、受益者は一定の期間内に委託会社に対して所定の手続きにより異議を述べることができます。一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一を超えるときは、繰上償還または信託約款の変更は行ないません。
- 2) 委託会社は、繰上償還または信託約款の変更を行なわない場合は、その旨およびその理由などを公告し、かつ知られたる受益者に書面を交付します。ただし、全ての受益者に書面を交付した場合は、原則として公告を行ないません。
- 3) なお、一定の期間内に、異議を述べた受益者の受益権口数が受益権総口数の二分の一以下で、繰上償還、信託約款の変更を行なう場合は、異議を述べた受益者は受託会社に対し、自己に帰属する受益権を信託財産をもって買い取るべき旨を請求できます。

<繰上償還、信託約款の重大な変更を行なう場合の手続きの流れ>



公告

公告は日本経済新聞に掲載します。

運用報告書の作成

- ・委託会社は、年2回（6月、12月）および償還後に期中の運用経過、組入有価証券の内容および有価証券の売買状況などを記載した運用報告書を作成します。
- ・交付運用報告書は、原則として知っている受益者に対して交付されます。
- ・運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページに掲載されます。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の交付請求があった場合には、交付します。

ホームページ アドレス www.nikkoam.com/

関係法人との契約について

販売会社との募集の取扱いなどに関する契約の有効期間は契約日より1年間とします。ただし、期間満了の3ヵ月前までに、販売会社、委託会社いずれからも別段の意思表示がないときは、自動的に1年間延長されるものとし、以後も同様とします。

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

- (1) 収益分配金・償還金受領権
 - ・受益者は、ファンドの収益分配金・償還金を、自己に帰属する受益権の口数に応じて受領する権利を有します。
 - ・ただし、受益者が収益分配金については支払開始日から5年間、償還金については支払開始日から10年間請求を行わない場合はその権利を失い、その金銭は委託会社に帰属します。
- (2) 解約請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき販売会社を通じて、委託会社に解約の請求をすることができます。
- (3) 帳簿閲覧権

受益者は、委託会社に対し、その営業時間内にファンドの信託財産に関する帳簿書類の閲覧を請求することができます。

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づき作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの計算期間は、6ヶ月未満であるため、財務諸表は6ヶ月ごとに作成しております。
- (3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、2023年12月16日から2024年6月17日までの特定期間の財務諸表について、PwC Japan有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型】

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	前期 2023年12月15日現在	当期 2024年 6月17日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	751,819,572	782,559,668
親投資信託受益証券	38,309,538,727	38,509,622,380
未収入金	86,192,280	23,153,468
未収利息	-	1,766
流動資産合計	39,147,550,579	39,315,337,282
資産合計	39,147,550,579	39,315,337,282
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	35,471,422	33,134,354
未払解約金	100,274,126	25,582,685
未払受託者報酬	1,769,167	1,952,701
未払委託者報酬	31,845,225	35,148,838
未払利息	95	-
その他未払費用	3,670,271	6,702,617
流動負債合計	173,030,306	102,521,195
負債合計	173,030,306	102,521,195
純資産の部		
元本等		
元本	35,471,422,735	33,134,354,286
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,503,097,538	6,078,461,801
（分配準備積立金）	7,303,442,520	9,573,348,931
元本等合計	38,974,520,273	39,212,816,087
純資産合計	38,974,520,273	39,212,816,087
負債純資産合計	39,147,550,579	39,315,337,282

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	前期		当期	
	自 至	2023年 6月16日 2023年12月15日	自 至	2023年12月16日 2024年 6月17日
営業収益				
受取利息		-		140,432
有価証券売買等損益		1,545,406,846		3,311,373,599
営業収益合計		1,545,406,846		3,311,514,031
営業費用				
支払利息		113,840		9,362
受託者報酬		10,806,422		10,895,596
委託者報酬		194,516,792		196,121,741
その他費用		4,393,209		3,889,256
営業費用合計		209,830,263		210,915,955
営業利益又は営業損失（ ）		1,335,576,583		3,100,598,076
経常利益又は経常損失（ ）		1,335,576,583		3,100,598,076
当期純利益又は当期純損失（ ）		1,335,576,583		3,100,598,076
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		402,296		15,648,123
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		2,498,134,406		3,503,097,538
剰余金増加額又は欠損金減少額		102,484,690		56,805,420
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		102,484,690		56,805,420
剰余金減少額又は欠損金増加額		215,306,593		362,968,238
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		215,306,593		362,968,238
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		217,389,252		203,422,872
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		3,503,097,538		6,078,461,801

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき当該親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	当ファンドの計算期間は原則として、毎月16日から翌月15日までとなっております。ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が始まるものいたしますので、当特定期間は2023年12月16日から2024年6月17日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	前期 2023年12月15日現在	当期 2024年6月17日現在
1. 期首元本額	36,865,702,370円	35,471,422,735円
期中追加設定元本額	1,301,936,668円	403,069,289円
期中一部解約元本額	2,696,216,303円	2,740,137,738円
2. 受益権の総数	35,471,422,735口	33,134,354,286口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

前期 自 2023年6月16日 至 2023年12月15日		当期 自 2023年12月16日 至 2024年6月17日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
自 2023年6月16日 至 2023年7月18日		自 2023年12月16日 至 2024年1月15日	
A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	71,954,080円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	86,195,842円
B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	70,212,173円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	888,629,111円
C 信託約款に定める収益調整金	2,682,826,878円	C 信託約款に定める収益調整金	2,757,803,840円
D 信託約款に定める分配準備積立 金	6,509,669,723円	D 信託約款に定める分配準備積立 金	7,166,538,292円
E 分配対象収益 (A+B+C+D)	9,334,662,854円	E 分配対象収益 (A+B+C+D)	10,899,167,085円
F 分配対象収益(1万口当たり)	2,551円	F 分配対象収益(1万口当たり)	3,124円
G 分配金額	36,589,520円	G 分配金額	34,885,091円
H 分配金額(1万口当たり)	10円	H 分配金額(1万口当たり)	10円
自 2023年7月19日 至 2023年8月15日		自 2024年1月16日 至 2024年2月15日	
A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	54,842,374円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	47,324,379円
B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	410,289,912円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	142,168,213円
C 信託約款に定める収益調整金	2,732,924,374円	C 信託約款に定める収益調整金	2,737,051,246円
D 信託約款に定める分配準備積立 金	6,569,029,512円	D 信託約款に定める分配準備積立 金	7,956,563,875円
E 分配対象収益 (A+B+C+D)	9,767,086,172円	E 分配対象収益 (A+B+C+D)	10,883,107,713円
F 分配対象収益(1万口当たり)	2,668円	F 分配対象収益(1万口当たり)	3,169円
G 分配金額	36,602,246円	G 分配金額	34,332,377円
H 分配金額(1万口当たり)	10円	H 分配金額(1万口当たり)	10円
自 2023年8月16日 至 2023年9月15日		自 2024年2月16日 至 2024年3月15日	
A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	92,709,562円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	92,765,380円
B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	536,305,097円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	279,468,818円
C 信託約款に定める収益調整金	2,760,601,929円	C 信託約款に定める収益調整金	2,717,861,715円
D 信託約款に定める分配準備積立 金	6,939,372,860円	D 信託約款に定める分配準備積立 金	8,007,674,400円
E 分配対象収益 (A+B+C+D)	10,328,989,448円	E 分配対象収益 (A+B+C+D)	11,097,770,313円
F 分配対象収益(1万口当たり)	2,831円	F 分配対象収益(1万口当たり)	3,269円
G 分配金額	36,484,543円	G 分配金額	33,939,265円
H 分配金額(1万口当たり)	10円	H 分配金額(1万口当たり)	10円
自 2023年9月16日 至 2023年10月16日		自 2024年3月16日 至 2024年4月15日	
A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	83,541,200円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	122,441,811円
B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	566,592,473円
C 信託約款に定める収益調整金	2,791,854,096円	C 信託約款に定める収益調整金	2,712,436,152円
D 信託約款に定める分配準備積立 金	7,431,358,513円	D 信託約款に定める分配準備積立 金	8,273,528,134円
E 分配対象収益 (A+B+C+D)	10,306,753,809円	E 分配対象収益 (A+B+C+D)	11,674,998,570円
F 分配対象収益(1万口当たり)	2,844円	F 分配対象収益(1万口当たり)	3,464円
G 分配金額	36,234,130円	G 分配金額	33,698,280円

H 分配金額(1万口当たり) 自 2023年10月17日 至 2023年11月15日	10円	H 分配金額(1万口当たり) 自 2024年 4月16日 至 2024年 5月15日	10円
A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	51,574,092円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	65,076,549円
B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	795,483,499円
C 信託約款に定める収益調整金	2,799,397,868円	C 信託約款に定める収益調整金	2,704,301,280円
D 信託約款に定める分配準備積立 金	7,407,596,684円	D 信託約款に定める分配準備積立 金	8,846,271,268円
E 分配対象収益(A+B+C+D)	10,258,568,644円	E 分配対象収益(A+B+C+D)	12,411,132,596円
F 分配対象収益(1万口当たり)	2,849円	F 分配対象収益(1万口当たり)	3,712円
G 分配金額	36,007,391円	G 分配金額	33,433,505円
H 分配金額(1万口当たり) 自 2023年11月16日 至 2023年12月15日	10円	H 分配金額(1万口当たり) 自 2024年 5月16日 至 2024年 6月17日	10円
A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	53,234,632円	A 計算期末における費用控除後の 配当等収益	35,887,036円
B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円	B 費用控除後、繰越欠損金補填後 の有価証券売買等損益	0円
C 信託約款に定める収益調整金	2,786,209,481円	C 信託約款に定める収益調整金	2,697,214,132円
D 信託約款に定める分配準備積立 金	7,285,679,310円	D 信託約款に定める分配準備積立 金	9,570,596,249円
E 分配対象収益(A+B+C+D)	10,125,123,423円	E 分配対象収益(A+B+C+D)	12,303,697,417円
F 分配対象収益(1万口当たり)	2,854円	F 分配対象収益(1万口当たり)	3,713円
G 分配金額	35,471,422円	G 分配金額	33,134,354円
H 分配金額(1万口当たり)	10円	H 分配金額(1万口当たり)	10円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	前期 自 2023年 6月16日 至 2023年12月15日	当期 自 2023年12月16日 至 2024年 6月17日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	前期 2023年12月15日現在	当期 2024年 6月17日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

前期(2023年12月15日現在)

売買目的有価証券

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	173,156,405
合計	173,156,405

当期(2024年6月17日現在)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	38,321,440
合計	38,321,440

(関連当事者との取引に関する注記)
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

前期 2023年12月15日現在	当期 2024年6月17日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0988円 (10,988円)
	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)
	1.1834円 (11,834円)

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	海外株式インデックスMSCI-KOKUSA I (ヘッジなし) マザーファンド	1,013,764,879	6,769,009,473	
	日本債券インデックスマザーファンド	4,636,888,576	6,108,173,321	
	海外債券インデックス(ヘッジなし) マザーファンド	2,150,070,500	6,579,430,737	
	日本株式インデックスTOPIXマザーファンド	2,280,029,201	6,377,925,683	
	日本リートインデックスJ-REITマザーファンド	2,486,965,212	6,033,128,907	
	海外リートインデックス(ヘッジなし) マザーファンド	1,941,127,001	6,641,954,259	
	合計	14,508,845,369	38,509,622,380	

(注)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

当ファンドは、「日本リートインデックスJ-REITマザーファンド」「海外リートインデックス(ヘッジなし)マザーファンド」「日本債券インデックスマザーファンド」「海外債券インデックス(ヘッジなし)マザーファンド」「日本株式インデックスTOPIXマザーファンド」「海外株式インデックスMSCI-KOKUSA I(ヘッジなし)マザーファンド」を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は同親投資信託です。なお、同親投資信託の状況は次の通りです。ただし、当該情報は監査の対象外であります。

(参考)

日本リートインデックスJ-REITマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2023年12月15日現在	2024年 6月17日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	116,027,060	214,999,838
投資証券	60,414,707,300	59,683,122,100
未収配当金	324,881,832	335,386,878
未収利息	-	485
流動資産合計	60,855,616,192	60,233,509,301
資産合計	60,855,616,192	60,233,509,301
負債の部		
流動負債		
未払金	-	179,233,450
未払解約金	4,233,592	1,431,980
未払利息	14	-
流動負債合計	4,233,606	180,665,430
負債合計	4,233,606	180,665,430
純資産の部		
元本等		
元本	24,331,712,371	24,754,972,956
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	36,519,670,215	35,297,870,915
元本等合計	60,851,382,586	60,052,843,871
純資産合計	60,851,382,586	60,052,843,871
負債純資産合計	60,855,616,192	60,233,509,301

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等の上場されている有価証券 金融商品取引所等の上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等の上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
-----------------	---

（貸借対照表に関する注記）

	2023年12月15日現在	2024年 6月17日現在
1. 期首	2023年 6月16日	2023年12月16日
期首元本額	23,882,441,576円	24,331,712,371円
期首からの追加設定元本額	2,898,862,648円	1,191,646,126円
期首からの一部解約元本額	2,449,591,853円	768,385,541円
元本の内訳		
世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	2,487,307,940円	2,486,965,212円
財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）資産成長型	1,568,056,361円	1,696,418,639円
インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	152,908,220円	159,795,689円
グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	19,527,581,580円	19,637,886,849円
財産3分法（適格機関投資家専用）	592,477,458円	722,843,641円
Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	1,056,413円	1,885,915円
Ni つみインデックスラップ世界10指数（均等型）	668,219円	1,160,932円
Ni つみインデックスラップ世界10指数（安定成長型）	299,332円	523,009円

財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)奇数月分配型	1,356,848円	47,493,070円
計	24,331,712,371円	24,754,972,956円
2. 受益権の総数	24,331,712,371口	24,754,972,956口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	自 2023年 6月16日 至 2023年12月15日	自 2023年12月16日 至 2024年 6月17日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。当該有価証券の性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	2023年12月15日現在	2024年 6月17日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(2023年12月15日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	1,774,272,705
合計	1,774,272,705

(2024年 6月17日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	4,844,672,098
合計	4,844,672,098

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、親投資信託の期首日から本書における開示対象ファンドの計算期間末日までに対応する金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2023年12月15日現在		2024年 6月17日現在	
1口当たり純資産額	2.5009円	1口当たり純資産額	2.4259円
(1万口当たり純資産額)	(25,009円)	(1万口当たり純資産額)	(24,259円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人 投資証券	1,234	146,229,000	
	サンケイリアルエステート投資法人 投資証券	1,945	161,824,000	
	S O S i L A 物流リート投資法人 投資証券	3,030	348,450,000	
	東海道リート投資法人 投資証券	1,038	126,324,600	
	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	2,097	1,342,080,000	
	森ヒルズリート投資法人 投資証券	7,141	927,615,900	
	産業ファンド投資法人 投資証券	11,061	1,350,548,100	
	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	5,958	1,906,560,000	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人 投資証券	3,186	1,167,669,000	
	G L P 投資法人 投資証券	20,398	2,649,700,200	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	2,986	939,097,000	
	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	10,579	2,645,807,900	
	星野リゾート・リート投資法人 投資証券	1,276	649,484,000	
	O n e リート投資法人 投資証券	1,059	270,045,000	
	イオンリート投資法人 投資証券	7,449	981,033,300	
	ヒューリックリート投資法人 投資証券	5,682	816,503,400	
	日本リート投資法人 投資証券	1,973	655,036,000	
	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	18,248	1,412,395,200	
	トーセイ・リート投資法人 投資証券	1,279	175,734,600	
	ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	1,497	189,220,800	
	サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	1,654	171,850,600	
	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	19,638	2,755,211,400	
	いちごホテルリート投資法人 投資証券	1,006	109,654,000	
	ラサールロジポート投資法人 投資証券	7,762	1,139,461,600	
	スターアジア不動産投資法人 投資証券	9,359	554,988,700	
	マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	936	122,241,600	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	2,526	1,088,706,000	
	日本ホテル&レジデンシャル投資法人 投資証券	928	68,857,600	
	投資法人みらい 投資証券	8,334	370,446,300	
	三菱地所物流リート投資法人 投資証券	2,097	787,423,500	
	C R E ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	2,614	371,449,400	
	ザイマックス・リート投資法人 投資証券	985	115,540,500	
	タカラレーベン不動産投資法人 投資証券	3,235	318,971,000	
	アドバンス・ロジスティクス投資法人 投資証券	2,661	316,659,000	
日本ビルファンド投資法人 投資証券	7,084	4,101,636,000		
ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	6,238	3,162,666,000		
日本都市ファンド投資法人 投資証券	29,108	2,613,898,400		

オリックス不動産投資法人 投資証券	12,100	1,906,960,000	
日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	4,153	1,358,031,000	
N T T都市開発リート投資法人 投資証券	6,157	712,980,600	
東急リアル・エステート投資法人 投資証券	4,071	629,783,700	
グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	4,484	446,606,400	
ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	13,584	1,931,644,800	
森トラストリート投資法人 投資証券	11,705	804,133,500	
インヴィンシブル投資法人 投資証券	29,403	1,996,463,700	
フロンティア不動産投資法人 投資証券	2,253	1,002,585,000	
平和不動産リート投資法人 投資証券	4,706	616,486,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	3,876	1,028,690,400	
福岡リート投資法人 投資証券	3,141	496,278,000	
K D X不動産投資法人 投資証券	17,207	2,624,067,500	
いちごオフィスリート投資法人 投資証券	4,976	404,548,800	
大和証券オフィス投資法人 投資証券	2,516	703,473,600	
阪急阪神リート投資法人 投資証券	2,896	379,955,200	
スターツプロシード投資法人 投資証券	1,053	211,021,200	
大和ハウスリート投資法人 投資証券	9,154	2,239,983,800	
ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	20,328	1,603,879,200	
大和証券リビング投資法人 投資証券	8,943	920,234,700	
ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	5,277	634,295,400	
合計	387,264	59,683,122,100	

(注) 券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2023年12月15日現在	2024年 6月17日現在
資産の部		
流動資産		
預金	477,393,957	342,192,595
コール・ローン	44,402,589	21,161,575
投資証券	58,225,890,535	55,931,087,801
未収入金	949,116	1,339,882
未収配当金	173,346,581	146,414,243
未収利息	-	47
流動資産合計	58,921,982,778	56,442,196,143
資産合計	58,921,982,778	56,442,196,143
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	5,760	-
未払解約金	41,841,846	6,033,914
未払利息	5	-
流動負債合計	41,847,611	6,033,914

	2023年12月15日現在	2024年 6月17日現在
負債合計	41,847,611	6,033,914
純資産の部		
元本等		
元本	18,594,523,388	16,493,547,462
剰余金		
剰余金又は欠損金()	40,285,611,779	39,942,614,767
元本等合計	58,880,135,167	56,436,162,229
純資産合計	58,880,135,167	56,436,162,229
負債純資産合計	58,921,982,778	56,442,196,143

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場(外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場)で評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値(平均値)等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。 (3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建取引等の処理基準 「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条及び第61条にしたがって処理しております。

(貸借対照表に関する注記)

	2023年12月15日現在	2024年 6月17日現在
1. 期首	2023年 6月16日	2023年12月16日
期首元本額	20,078,950,947円	18,594,523,388円
期首からの追加設定元本額	1,479,766,747円	13,921,194円
期首からの一部解約元本額	2,964,194,306円	2,114,897,120円
元本の内訳		
世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	2,138,039,996円	1,941,127,001円
インデックスファンド海外先進国リート(適格機関投資家向け)	8,410,515円	- 円
グローバル3倍3分法ファンド(適格機関投資家向け)	16,214,506,178円	14,316,410,946円
Tracers グローバル3分法(おとなのバランス)	11,490,212円	20,686,523円
Ni つみインデックスラップ世界10指数(均等型)	552,803円	841,098円
Ni つみインデックスラップ世界10指数(安定成長型)	495,666円	749,943円
海外先進国REITインデックスファンド(適格機関投資家向け)	221,028,018円	213,731,951円
計	18,594,523,388円	16,493,547,462円
2. 受益権の総数	18,594,523,388口	16,493,547,462口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	自 2023年 6月16日 至 2023年12月15日	自 2023年12月16日 至 2024年 6月17日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

	自 2023年 6月16日 至 2023年12月15日	自 2023年12月16日 至 2024年 6月17日
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、為替予約取引があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	2023年12月15日現在	2024年 6月17日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありませぬ。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(2023年12月15日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	3,842,320,941
合計	3,842,320,941

(2024年 6月17日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	1,597,469,886
合計	1,597,469,886

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、親投資信託の期首日から本書における開示対象ファンドの計算期間末日までに対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

(2023年12月15日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	時価	評価損益
			うち1年超	
	為替予約取引			

市場取引以外の取引	売建	28,480,000	-	28,485,760	5,760
	米ドル	28,480,000	-	28,485,760	5,760
合計		28,480,000	-	28,485,760	5,760

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 本書における開示対象ファンドの計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・同計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物売買相場の仲値をもとに計算しております。
- ・同計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

(2) 本書における開示対象ファンドの計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については同計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

(3) 上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(2024年 6月17日現在)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2023年12月15日現在		2024年 6月17日現在	
1口当たり純資産額	3.1665円	1口当たり純資産額	3.4217円
(1万口当たり純資産額)	(31,665円)	(1万口当たり純資産額)	(34,217円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資証券	ACADIA REALTY TRUST	27,031	467,636.30	
		AGREE REALTY CORPORATION	26,931	1,650,062.37	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	18,817	310,668.67	
		ALEXANDER'S INC	536	114,302.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	41,858	4,868,922.56	
		ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	3,159	47,669.31	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	12,925	279,826.25	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	84,612	2,998,649.28	
		AMERICOLD REALTY TRUST INC	70,939	1,808,235.11	
		APARTMENT INCOME REIT CO	38,608	1,502,623.36	
		APARTMENT INVT&MGMT CO -A	34,628	279,447.96	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	56,643	817,924.92	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	18,326	202,319.04	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	8,742	8,737.62	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	37,743	7,619,934.27	

BOSTON PROPERTIES INC	38,426	2,368,578.64	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	12,905	37,811.65	
BRANDYWINE REALTY TRUST	45,029	206,232.82	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	80,002	1,782,444.56	
BROADSTONE NET LEASE INC-A	49,747	760,134.16	
BRT APARTMENTS CORP	3,398	58,819.38	
CAMDEN PROPERTY TRUST	28,426	3,071,145.04	
CARETRUST REIT INC	34,923	879,011.91	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	6,784	148,366.08	
CENTERSPACE	3,864	261,360.96	
CHATHAM LODGING TRUST	12,668	104,891.04	
CITY OFFICE REIT INC	11,825	58,060.75	
CLIPPER REALTY INC	3,393	12,452.31	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	6,767	158,144.79	
COPT DEFENSE PROPERTIES	29,908	729,157.04	
COUSINS PROPERTIES INC	40,164	927,386.76	
CTO REALTY GROWTH INC	5,391	93,911.22	
CUBESMART	59,752	2,642,830.96	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	55,280	453,848.80	
DIGITAL CORE REIT MANAGEMENT	209,224	112,980.96	
DIGITAL REALTY TRUST INC	85,905	12,878,877.60	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	58,979	166,320.78	
DOUGLAS EMMETT INC	44,423	590,825.90	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	500,700	68,595.90	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	25,603	311,588.51	
EASTGROUP PROPERTIES INC	12,673	2,101,943.78	
ELME COMMUNITIES	23,811	371,927.82	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	34,826	324,578.32	
EPR PROPERTIES	20,066	809,261.78	
EQUINIX INC	24,970	19,133,512.20	
EQUITY COMMONWEALTH	29,834	573,409.48	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	49,747	3,120,131.84	
EQUITY RESIDENTIAL-REIT	91,884	6,129,581.64	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	41,452	1,144,075.20	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	17,092	4,760,122.00	
EXTRA SPACE STORAGE INC	56,186	8,797,042.02	
FARMLAND PARTNERS INC	11,078	126,289.20	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	19,577	1,980,996.63	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC	35,145	1,669,036.05	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	24,410	595,115.80	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORP	26,426	43,602.90	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	71,213	3,091,356.33	
GETTY REALTY CORPORATION	12,818	343,137.86	

GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION	10,804	152,228.36	
GLADSTONE LAND CORP	8,550	114,399.00	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	14,729	132,855.58	
GLOBAL NET LEASE INC	52,000	374,920.00	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	101,524	1,675,146.00	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	188,516	3,704,339.40	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	27,853	715,265.04	
HOST HOTELS & RESORTS INC	187,859	3,347,647.38	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	34,874	172,626.30	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	59,440	1,065,759.20	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	15,324	57,771.48	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	7,407	789,734.34	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	18,090	447,184.80	
INVITATION HOMES INC	152,946	5,429,583.00	
IRON MOUNTAIN INC	77,640	6,833,872.80	
JBG SMITH PROPERTIES	23,314	342,715.80	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	219,100	30,674.00	
KILROY REALTY CORPORATION	28,406	903,878.92	
KIMCO REALTY CORP	177,187	3,322,256.25	
KITE REALTY GROUP TRUST	58,411	1,282,705.56	
LTC PROPERTIES INC	11,104	373,760.64	
LXP INDUSTRIAL TRUST	77,103	678,506.40	
MACERICH CO/THE	57,176	827,908.48	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	432,047	29,379.19	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	159,365	772,920.25	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	31,058	4,327,000.56	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	20,509	837,792.65	
NATL HEALTH INVESTORS INC	11,541	766,784.04	
NET LEASE OFFICE PROPERTY	4,251	105,637.35	
NETSTREIT CORP	18,339	314,513.85	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	9,278	44,905.52	
NEXPOINT RESIDENTIAL	5,677	210,503.16	
NNN REIT INC	48,644	2,048,885.28	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	15,503	34,726.72	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	65,522	2,120,947.14	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	4,069	96,028.40	
ORION OFFICE REIT INC	12,343	42,336.49	
PARAMOUNT GROUP INC	41,575	192,908.00	
PARK HOTELS & RESORTS INC	55,902	820,641.36	
PEAKSTONE REALTY TRUST	9,704	111,304.88	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	31,421	436,437.69	
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	32,643	1,052,083.89	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	33,502	237,529.18	

		PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	9,038	189,346.10	
		POSTAL REALTY TRUST INC- A	5,728	75,552.32	
		PRIME US REIT	202,620	23,706.54	
		PROLOGIS INC	245,657	27,584,824.53	
		PUBLIC STORAGE	42,088	11,921,426.00	
		REALTY INCOME CORP	221,442	11,818,359.54	
		REGENCY CENTERS CORP	43,788	2,704,784.76	
		RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS	33,628	413,960.68	
		REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	55,930	2,507,341.90	
		RLJ LODGING TRUST	41,229	394,561.53	
		RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	15,889	1,570,309.87	
		SABRA HEALTH CARE REIT INC	61,891	884,422.39	
		SAFEHOLD INC	11,591	217,331.25	
		SAUL CENTERS INC	3,408	125,209.92	
		SERVICE PROPERTIES TRUST	43,770	215,786.10	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	86,669	12,898,947.27	
		SITE CENTERS CORP	47,674	694,133.44	
		SL GREEN REALTY CORP	17,168	977,374.24	
		STAG INDUSTRIAL INC	48,224	1,685,911.04	
		SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	29,619	172,086.39	
		SUN COMMUNITIES INC	33,133	3,864,633.12	
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	54,732	545,130.72	
		TANGER INC	28,596	773,521.80	
		TERRENO REALTY CORP	24,815	1,439,021.85	
		UDR INC	80,587	3,246,044.36	
		UMH PROPERTIES INC	15,970	246,257.40	
		UNITI GROUP INC	63,878	175,664.50	
		UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST	3,614	139,897.94	
		URBAN EDGE PROPERTIES	31,065	556,995.45	
		VENTAS INC	107,054	5,363,405.40	
		VERIS RESIDENTIAL INC	21,462	324,290.82	
		VICI PROPERTIES INC	275,374	7,790,330.46	
		VORNADO REALTY TRUST	42,466	1,079,910.38	
		WELLTOWER INC	147,226	15,317,393.04	
		WHITESTONE REIT	11,667	156,104.46	
		WP CAREY INC	58,243	3,266,849.87	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	27,751	395,174.24	
		米ドル小計	7,485,126	276,110,864.34 (43,495,744,459)	
加ドル	投資証券	ALLIED PROPERTIES RE INVST TR	16,464	259,143.36	
		ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15,987	103,435.89	
		BOARDWALK EQUITIES INC	6,351	436,440.72	
		BSR REAL ESTATE INVESTMENT T	5,317	81,084.25	

		BTB REAL ESTATE INVESTMENT T	10,240	32,204.80	
		CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	21,800	952,442.00	
		CHOICE PROPERTIES REIT	44,021	559,506.91	
		CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	14,914	186,574.14	
		CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	13,804	186,215.96	
		DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	35,381	443,677.74	
		DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	2,395	45,648.70	
		FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	28,197	414,777.87	
		GRANITE REAL ESTATE INVESTME	8,208	547,719.84	
		H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	33,939	305,451.00	
		INTERRENT REAL ESTATE INVEST	19,632	230,872.32	
		KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	15,022	257,627.30	
		MINTO APARTMENT REAL ESTATE	5,648	84,550.56	
		MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	4,944	74,555.52	
		NEXUS INDUSTRIAL REIT	7,802	54,457.96	
		NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	32,841	159,607.26	
		PRIMARIS REIT	12,438	167,415.48	
		PRO REAL ESTATE INVESTMENT T	8,609	43,389.36	
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	39,494	659,549.80	
		SLATE GROCERY REIT	6,982	77,709.66	
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	19,883	437,227.17	
		TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	2,223	19,073.34	
		加ドル小計	432,536	6,820,358.91 (782,226,963)	
ユーロ	投資証券	AEDIFICA	12,688	714,334.40	
		ALTAREA	1,217	102,958.20	
		CARE PROPERTY INVEST	10,115	141,205.40	
		CARMILA	14,591	233,747.82	
		COFINIMMO	9,837	564,643.80	
		COVIVIO	12,744	570,676.32	
		CROMWELL REIT EUR	81,360	115,531.20	
		EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	11,271	244,017.15	
		GECINA SA	13,674	1,251,854.70	
		HAMBORNER REIT AG	20,332	131,751.36	
		ICADE	8,080	206,848.00	
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	17,269	31,498.65	
		INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	76,015	456,850.15	
		IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	129,693	118,409.70	
		KLEPIERRE	51,966	1,327,211.64	
		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	14,373	99,173.70	
		MERCIALYS	24,965	270,121.30	
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	89,455	948,223.00	
		MONTEA	4,826	383,667.00	

		NSI NV	4,727	92,932.82
		RETAIL ESTATES	3,481	217,910.60
		SHURGARD SELF STORAGE LTD	8,266	319,894.20
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	26,984	1,956,340.00
		VASTNED RETAIL	4,832	113,068.80
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	46,068	1,165,520.40
		WERELDHAVE NV	9,878	131,970.08
		XIOR STUDENT HOUSING NV	8,768	251,641.60
ユーロ小計			717,475	12,162,001.99 (2,051,000,015)
英ポンド	投資証券	ABRDN PROPERTY INCOME TRUST	95,935	48,734.98
		AEW UK REIT PLC	48,766	41,792.46
		ASSURA PLC	803,210	319,035.01
		BALANCED COMM PROPERTY TRUST	191,534	144,608.17
		BIG YELLOW GROUP PLC	51,902	608,291.44
		BRITISH LAND COMPANY PLC	249,787	1,065,591.34
		CLS HOLDINGS PLC	40,564	34,966.16
		CUSTODIAN PROPERTY INCOME RE	124,321	89,511.12
		DERWENT LONDON PLC	29,748	690,748.56
		EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	168,582	157,624.17
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	106,734	362,361.93
		HAMMERSON PLC	1,004,970	281,592.59
		HELICAL PLC	29,147	63,540.46
		HOME REIT PLC	256,438	97,574.65
		IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	106,581	90,700.43
		INTU PROPERTIES PLC	758,746	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	199,714	1,242,221.08
		LIFE SCIENCE REIT PLC	110,213	37,803.05
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	541,559	1,053,332.25
		NEWRIVER REIT PLC	95,617	69,226.70
		PICTON PROPERTY INCOME LTD	138,667	89,024.21
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES	361,746	329,912.35
		PRS REIT PLC/THE	145,505	111,311.32
		REGIONAL REIT LTD	147,696	31,606.94
		SAFESTORE HOLDINGS PLC	57,366	457,780.68
		SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	139,902	62,256.39
		SEGRO PLC	355,760	3,233,858.40
		SHAFTESBURY CAPITAL PLC	519,907	711,752.68
		SUPERMARKET INCOME REIT PLC	336,736	242,786.65
		TARGET HEALTHCARE REIT PLC	169,014	134,366.13
		TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	103,176	58,500.79
		TRITAX BIG BOX REIT PLC	606,306	932,498.62
		UNITE GROUP PLC/THE	105,494	959,995.40

		URBAN LOGISTICS REIT PLC	116,651	139,514.59
		WAREHOUSE REIT PLC	103,182	82,132.87
		WORKSPACE GROUP PLC	34,600	195,144.00
英ポンド小計			8,455,776	14,271,698.57 (2,852,484,393)
豪ドル	投資証券	ABACUS GROUP	125,548	141,869.24
		ABACUS STORAGE KING	147,049	179,399.78
		ARENA REIT	91,703	341,135.16
		BWP TRUST	151,260	544,536.00
		CENTURIA CAPITAL GROUP	209,494	362,424.62
		CENTURIA INDUSTRIAL REIT	148,189	460,867.79
		CENTURIA OFFICE REIT	121,951	145,121.69
		CHARTER HALL GROUP	125,339	1,540,416.31
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	180,627	619,550.61
		CHARTER HALL RETAIL REIT	142,745	468,203.60
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	93,916	226,337.56
		CROMWELL PROPERTY GROUP	384,121	161,330.82
		DEXUS INDUSTRIA REIT	60,062	177,783.52
		DEXUS/AU	288,730	1,873,857.70
		GDI PROPERTY GROUP	181,454	109,779.67
		GOODMAN GROUP	459,635	16,441,143.95
		GPT GROUP	511,856	2,083,253.92
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	76,727	175,704.83
		HEALTHCO REIT	135,702	154,021.77
		HMC CAPITAL LTD	64,211	474,519.29
		HOMEKO DAILY NEEDS REIT	494,518	605,784.55
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	55,089	177,937.47
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	99,588	484,993.56
		MIRVAC GROUP	1,053,700	1,986,224.50
		NATIONAL STORAGE REIT	345,303	797,649.93
		REGION RE LTD	314,446	691,781.20
		RURAL FUNDS GROUP	103,455	207,944.55
		SCENTRE GROUP	1,386,467	4,325,777.04
		STOCKLAND	634,403	2,816,749.32
		VICINITY CENTRES	1,034,047	1,923,327.42
		WAYPOINT REIT	184,377	427,754.64
豪ドル小計			9,405,712	41,127,182.01 (4,284,218,549)
ニュー ジーラン ドドル	投資証券	GOODMAN PROPERTY TRUST	354,249	745,694.14
ニュージーランドドル小計			354,249	745,694.14 (72,078,795)
香港ドル	投資証券	CHAMPION REIT	503,000	804,800.00
		FORTUNE REIT	398,900	1,555,710.00

		LINK REIT	686,080	22,366,208.00
		PROSPERITY REIT	317,000	427,950.00
		SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	306,000	529,380.00
		YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	539,610	555,798.30
香港ドル小計			2,750,590	26,239,846.30 (528,995,301)
シンガポールドル	投資証券	AIMS APAC REIT	196,717	249,830.59
		CAPITALAND ASCENDAS REIT	951,332	2,444,923.24
		CAPITALAND ASCOTT TRUST	672,392	598,428.88
		CAPITALAND CHINA TRUST	310,285	203,236.67
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	1,351,992	2,622,864.48
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	172,200	164,451.00
		EC WORLD REIT	70,300	19,684.00
		ESR-LOGOS REIT	1,596,519	447,025.32
		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	295,600	181,794.00
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	309,905	666,295.75
		FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	767,760	733,210.80
		KEPPEL DC REIT	357,477	639,883.83
		KEPPEL REIT	617,100	518,364.00
		LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	477,052	264,763.86
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	556,908	1,202,921.28
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	890,887	1,175,970.84
		MAPLETREE PAN ASIA COM TRUST	624,031	761,317.82
		PARAGON REIT	345,400	288,409.00
		PARKWAYLIFE REAL ESTATE	102,500	373,100.00
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	154,400	102,676.00
STARHILL GLOBAL REIT	394,000	189,120.00		
SUNTEC REIT	619,000	656,140.00		
シンガポールドル小計			11,833,757	14,504,411.36 (1,689,328,791)
韓国ウォン	投資証券	D&D PLATFORM REIT CO LTD	16,715	58,669,650.00
		ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	45,468	209,380,140.00
		JR REIT XXVII	45,388	187,679,380.00
		KORAMCO LIFE INFRA REIT	11,530	53,268,600.00
		LOTTE REIT CO LTD	34,731	115,654,230.00
		NH ALL-ONE REIT CO LTD	12,699	46,859,310.00
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	22,911	139,986,210.00
		SK REITS CO LTD	34,097	165,881,905.00
韓国ウォン小計			223,539	977,379,425.00 (111,714,468)
イスラエルシェケル	投資証券	MENIVIM- THE NEW REIT LTD	197,705	307,628.98
		REIT 1 LTD	56,023	771,996.94
		SELLA CAPITAL REAL ESTATE LT	63,926	414,943.66
			317,654	1,494,569.58

イスラエルシェケル小計		(63,296,067)	
合計		55,931,087,801 (55,931,087,801)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	投資証券 138銘柄	100.0%	77.8%
加ドル	投資証券 26銘柄	100.0%	1.4%
ユーロ	投資証券 27銘柄	100.0%	3.7%
英ポンド	投資証券 36銘柄	100.0%	5.1%
豪ドル	投資証券 31銘柄	100.0%	7.7%
ニュージーランドドル	投資証券 1銘柄	100.0%	0.1%
香港ドル	投資証券 6銘柄	100.0%	0.9%
シンガポールドル	投資証券 22銘柄	100.0%	3.0%
韓国ウォン	投資証券 8銘柄	100.0%	0.2%
イスラエルシェケル	投資証券 3銘柄	100.0%	0.1%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

日本債券インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

	2023年12月15日現在	2024年 6月17日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	229,396,195	239,990,104
国債証券	45,460,262,000	48,934,876,410
地方債証券	2,728,652,612	1,921,804,621
特殊債券	2,407,153,000	2,096,553,711
社債券	1,196,809,000	1,504,194,000
未収利息	141,083,762	150,392,527
前払費用	3,800,469	7,044,677
流動資産合計	52,167,157,038	54,854,856,050
資産合計	52,167,157,038	54,854,856,050
負債の部		
流動負債		
未払解約金	13,855,986	11,062,299
未払利息	29	-
流動負債合計	13,856,015	11,062,299
負債合計	13,856,015	11,062,299
純資産の部		
元本等		
元本	38,876,887,677	41,634,998,227
剰余金		
剰余金又は欠損金()	13,276,413,346	13,208,795,524
元本等合計	52,153,301,023	54,843,793,751

純資産合計	52,153,301,023	54,843,793,751
負債純資産合計	52,167,157,038	54,854,856,050

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場(外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値(平均値)等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
-----------------	---

(貸借対照表に関する注記)

		2023年12月15日現在	2024年 6月17日現在
1.	期首	2023年 6月16日	2023年12月16日
	期首元本額	37,056,558,627円	38,876,887,677円
	期首からの追加設定元本額	2,454,562,009円	3,466,012,517円
	期首からの一部解約元本額	634,232,959円	707,901,967円
	元本の内訳		
	DCインデックスバランス(株式20)	5,774,757,942円	6,395,584,919円
	DCインデックスバランス(株式40)	5,582,044,245円	6,335,058,393円
	DCインデックスバランス(株式60)	4,434,324,560円	5,298,425,593円
	DCインデックスバランス(株式80)	805,916,042円	1,028,653,945円
	インデックスファンド日本債券(DC専用)	2,196,381,287円	2,175,942,211円
	世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	4,634,497,139円	4,636,888,576円
	インデックス・アセットバランス・オープン(適格機関投資家向け)	1,729,528,043円	1,839,701,160円
	Tracers グローバル3分法(おとなのバランス)	16,547,519円	29,393,855円
	Ni つみインデックスラップ世界10指数(均等型)	1,255,173円	2,159,550円
	Ni つみインデックスラップ世界10指数(安定成長型)	1,124,883円	1,939,689円
	国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	3,086,148,563円	3,067,373,592円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	1,584,535,452円	1,678,073,242円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	1,607,037,096円	1,763,683,474円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	944,938,176円	1,075,654,373円
	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	144,661,389円	170,963,633円
	インデックスファンド日本債券(1年決算型)	5,925,655,949円	5,720,716,710円
	日本債券インデックスファンド(個人型年金向け)	407,534,219円	414,785,312円
	計	38,876,887,677円	41,634,998,227円
2.	受益権の総数	38,876,887,677口	41,634,998,227口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	自 2023年 6月16日 至 2023年12月15日	自 2023年12月16日 至 2024年 6月17日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左

金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	2023年12月15日現在	2024年 6月17日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(2023年12月15日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	750,960,620
地方債証券	57,788
特殊債券	4,283,000
社債券	691,000
合計	755,876,832

(2024年 6月17日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	438,058,350
地方債証券	5,538,879
特殊債券	5,097,289
社債券	4,634,000
合計	453,328,518

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、親投資信託の期首日から本書における開示対象ファンドの計算期間末日までに対応する金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2023年12月15日現在		2024年 6月17日現在	
1口当たり純資産額	1.3415円	1口当たり純資産額	1.3173円
(1万口当たり純資産額)	(13,415円)	(1万口当たり純資産額)	(13,173円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第450回利付国債(2年)	200,000,000	199,710,000	
	第451回利付国債(2年)	50,000,000	49,918,500	
	第454回利付国債(2年)	100,000,000	99,883,000	
	第455回利付国債(2年)	100,000,000	99,717,000	
	第456回利付国債(2年)	100,000,000	99,823,000	
	第457回利付国債(2年)	150,000,000	149,695,500	
	第458回利付国債(2年)	50,000,000	49,966,000	
	第149回利付国債(5年)	100,000,000	99,360,000	
	第150回利付国債(5年)	50,000,000	49,626,500	
	第151回利付国債(5年)	290,000,000	287,506,000	
	第152回利付国債(5年)	100,000,000	99,399,000	
	第153回利付国債(5年)	300,000,000	297,054,000	
	第155回利付国債(5年)	100,000,000	99,740,000	
	第156回利付国債(5年)	200,000,000	198,788,000	
	第157回利付国債(5年)	150,000,000	148,863,000	
	第158回利付国債(5年)	230,000,000	227,405,600	
	第159回利付国債(5年)	150,000,000	148,050,000	
	第160回利付国債(5年)	120,000,000	118,912,800	
	第161回利付国債(5年)	120,000,000	119,385,600	
	第162回利付国債(5年)	130,000,000	129,157,600	
	第163回利付国債(5年)	270,000,000	269,379,000	
	第164回利付国債(5年)	130,000,000	128,365,900	
	第165回利付国債(5年)	130,000,000	128,939,200	
	第166回利付国債(5年)	140,000,000	139,505,800	
	第167回利付国債(5年)	120,000,000	119,414,400	
	第168回利付国債(5年)	150,000,000	150,660,000	
	第1回利付国債(40年)	70,000,000	76,605,900	
	第2回利付国債(40年)	125,000,000	131,423,750	
	第3回利付国債(40年)	85,000,000	88,718,750	
	第4回利付国債(40年)	95,000,000	98,654,650	
	第5回利付国債(40年)	95,000,000	94,242,850	
	第6回利付国債(40年)	110,000,000	106,341,400	
	第7回利付国債(40年)	130,000,000	119,492,100	
	第8回利付国債(40年)	115,000,000	97,321,050	
第9回利付国債(40年)	210,000,000	127,751,400		
第10回利付国債(40年)	175,000,000	125,027,000		

第11回利付国債(40年)	140,000,000	95,383,400	
第12回利付国債(40年)	175,000,000	104,749,750	
第13回利付国債(40年)	210,000,000	123,370,800	
第14回利付国債(40年)	210,000,000	131,428,500	
第15回利付国債(40年)	230,000,000	158,978,300	
第16回利付国債(40年)	220,000,000	167,048,200	
第17回利付国債(40年)	50,000,000	49,165,500	
第1回クライメート・トランジション利付国債(5年)	60,000,000	59,523,000	
第1回クライメート・トランジション利付国債(10年)	70,000,000	68,833,800	
第340回利付国債(10年)	620,000,000	621,785,600	
第341回利付国債(10年)	700,000,000	701,050,000	
第342回利付国債(10年)	630,000,000	628,456,500	
第343回利付国債(10年)	645,000,000	642,742,500	
第344回利付国債(10年)	700,000,000	697,011,000	
第345回利付国債(10年)	660,000,000	656,627,400	
第346回利付国債(10年)	660,000,000	656,033,400	
第347回利付国債(10年)	680,000,000	675,240,000	
第348回利付国債(10年)	500,000,000	495,890,000	
第349回利付国債(10年)	590,000,000	584,383,200	
第350回利付国債(10年)	540,000,000	533,908,800	
第351回利付国債(10年)	535,000,000	528,045,000	
第352回利付国債(10年)	520,000,000	512,288,400	
第353回利付国債(10年)	400,000,000	393,204,000	
第354回利付国債(10年)	325,000,000	318,886,750	
第355回利付国債(10年)	350,000,000	342,993,000	
第356回利付国債(10年)	350,000,000	342,562,500	
第357回利付国債(10年)	560,000,000	547,405,600	
第358回利付国債(10年)	590,000,000	575,834,100	
第359回利付国債(10年)	420,000,000	409,130,400	
第360回利付国債(10年)	580,000,000	563,696,200	
第361回利付国債(10年)	460,000,000	446,011,400	
第362回利付国債(10年)	400,000,000	386,892,000	
第363回利付国債(10年)	500,000,000	482,220,000	
第364回利付国債(10年)	500,000,000	480,770,000	
第365回利付国債(10年)	410,000,000	392,874,300	
第366回利付国債(10年)	480,000,000	462,009,600	
第367回利付国債(10年)	420,000,000	402,855,600	
第368回利付国債(10年)	450,000,000	430,249,500	
第369回利付国債(10年)	490,000,000	478,862,300	
第370回利付国債(10年)	420,000,000	409,189,200	
第371回利付国債(10年)	480,000,000	462,120,000	

第372回利付国債(10年)	500,000,000	497,425,000	
第373回利付国債(10年)	440,000,000	428,436,800	
第374回利付国債(10年)	310,000,000	306,531,100	
第1回利付国債(30年)	50,000,000	55,934,000	
第3回利付国債(30年)	70,000,000	77,200,900	
第5回利付国債(30年)	80,000,000	88,592,800	
第6回利付国債(30年)	50,000,000	56,297,000	
第8回利付国債(30年)	170,000,000	184,298,700	
第9回利付国債(30年)	70,000,000	73,579,100	
第10回利付国債(30年)	50,000,000	51,248,000	
第11回利付国債(30年)	170,000,000	182,852,000	
第12回利付国債(30年)	50,000,000	55,530,500	
第13回利付国債(30年)	180,000,000	198,207,000	
第14回利付国債(30年)	108,000,000	122,855,400	
第15回利付国債(30年)	147,000,000	168,742,770	
第16回利付国債(30年)	35,000,000	40,202,050	
第17回利付国債(30年)	50,000,000	56,980,500	
第18回利付国債(30年)	110,000,000	124,246,100	
第19回利付国債(30年)	40,000,000	45,177,600	
第20回利付国債(30年)	40,000,000	46,024,400	
第21回利付国債(30年)	70,000,000	79,023,000	
第22回利付国債(30年)	70,000,000	80,534,300	
第23回利付国債(30年)	55,000,000	63,300,050	
第24回利付国債(30年)	68,000,000	78,282,280	
第25回利付国債(30年)	60,000,000	67,655,400	
第26回利付国債(30年)	170,000,000	193,526,300	
第27回利付国債(30年)	89,000,000	102,350,000	
第28回利付国債(30年)	144,000,000	165,415,680	
第29回利付国債(30年)	176,000,000	199,645,600	
第30回利付国債(30年)	147,000,000	164,382,750	
第31回利付国債(30年)	120,000,000	132,235,200	
第32回利付国債(30年)	160,000,000	178,124,800	
第33回利付国債(30年)	175,000,000	186,802,000	
第34回利付国債(30年)	160,000,000	174,995,200	
第35回利付国債(30年)	193,000,000	204,684,220	
第36回利付国債(30年)	195,000,000	206,354,850	
第37回利付国債(30年)	211,000,000	219,169,920	
第38回利付国債(30年)	165,000,000	168,182,850	
第39回利付国債(30年)	165,000,000	170,474,700	
第40回利付国債(30年)	130,000,000	131,885,000	
第41回利付国債(30年)	160,000,000	159,416,000	
第42回利付国債(30年)	135,000,000	134,106,300	

第43回利付国債(30年)	155,000,000	153,623,600	
第44回利付国債(30年)	150,000,000	148,323,000	
第45回利付国債(30年)	120,000,000	114,265,200	
第46回利付国債(30年)	160,000,000	151,944,000	
第47回利付国債(30年)	125,000,000	120,637,500	
第48回利付国債(30年)	135,000,000	125,253,000	
第49回利付国債(30年)	140,000,000	129,509,800	
第50回利付国債(30年)	145,000,000	118,264,900	
第51回利付国債(30年)	140,000,000	101,158,400	
第52回利付国債(30年)	190,000,000	143,453,800	
第53回利付国債(30年)	135,000,000	103,891,950	
第54回利付国債(30年)	160,000,000	128,468,800	
第55回利付国債(30年)	110,000,000	87,953,800	
第56回利付国債(30年)	140,000,000	111,560,400	
第57回利付国債(30年)	190,000,000	150,770,700	
第58回利付国債(30年)	180,000,000	142,237,800	
第59回利付国債(30年)	170,000,000	130,556,600	
第60回利付国債(30年)	120,000,000	96,392,400	
第61回利付国債(30年)	100,000,000	76,116,000	
第62回利付国債(30年)	120,000,000	86,200,800	
第63回利付国債(30年)	120,000,000	83,341,200	
第64回利付国債(30年)	100,000,000	69,038,000	
第65回利付国債(30年)	110,000,000	75,490,800	
第66回利付国債(30年)	180,000,000	122,799,600	
第67回利付国債(30年)	110,000,000	79,054,800	
第68回利付国債(30年)	140,000,000	100,135,000	
第69回利付国債(30年)	145,000,000	106,183,500	
第70回利付国債(30年)	140,000,000	102,138,400	
第71回利付国債(30年)	160,000,000	116,192,000	
第72回利付国債(30年)	160,000,000	115,752,000	
第73回利付国債(30年)	150,000,000	108,106,500	
第74回利付国債(30年)	150,000,000	117,165,000	
第75回利付国債(30年)	180,000,000	151,664,400	
第76回利付国債(30年)	150,000,000	129,315,000	
第77回利付国債(30年)	160,000,000	144,572,800	
第78回利付国債(30年)	150,000,000	128,865,000	
第79回利付国債(30年)	140,000,000	114,098,600	
第80回利付国債(30年)	150,000,000	141,459,000	
第81回利付国債(30年)	150,000,000	134,862,000	
第82回利付国債(30年)	100,000,000	94,161,000	
第82回利付国債(20年)	60,000,000	61,452,600	
第87回利付国債(20年)	130,000,000	134,460,300	

第88回利付国債(20年)	300,000,000	312,147,000	
第90回利付国債(20年)	16,000,000	16,687,200	
第91回利付国債(20年)	250,000,000	261,297,500	
第92回利付国債(20年)	60,000,000	62,686,800	
第93回利付国債(20年)	60,000,000	62,767,800	
第94回利付国債(20年)	50,000,000	52,443,000	
第95回利付国債(20年)	82,000,000	86,819,960	
第96回利付国債(20年)	248,000,000	261,101,840	
第97回利付国債(20年)	45,000,000	47,688,750	
第98回利付国債(20年)	94,000,000	99,313,820	
第99回利付国債(20年)	117,000,000	124,028,190	
第100回利付国債(20年)	80,000,000	85,356,000	
第101回利付国債(20年)	66,000,000	70,907,100	
第102回利付国債(20年)	81,000,000	87,334,200	
第103回利付国債(20年)	71,000,000	76,272,460	
第104回利付国債(20年)	33,000,000	35,190,540	
第105回利付国債(20年)	77,000,000	82,341,490	
第106回利付国債(20年)	62,000,000	66,560,100	
第107回利付国債(20年)	130,000,000	139,382,100	
第108回利付国債(20年)	134,000,000	142,487,560	
第109回利付国債(20年)	107,000,000	114,007,430	
第110回利付国債(20年)	98,000,000	105,328,440	
第111回利付国債(20年)	95,000,000	102,936,300	
第112回利付国債(20年)	80,000,000	86,292,000	
第113回利付国債(20年)	290,000,000	313,930,800	
第114回利付国債(20年)	52,000,000	56,473,560	
第115回利付国債(20年)	125,000,000	136,425,000	
第116回利付国債(20年)	135,000,000	147,792,600	
第117回利付国債(20年)	343,000,000	373,585,310	
第118回利付国債(20年)	70,000,000	76,032,600	
第119回利付国債(20年)	60,000,000	64,472,400	
第120回利付国債(20年)	170,000,000	180,638,600	
第121回利付国債(20年)	142,000,000	153,689,440	
第122回利付国債(20年)	17,000,000	18,296,420	
第123回利付国債(20年)	195,000,000	213,918,900	
第124回利付国債(20年)	90,000,000	98,166,600	
第125回利付国債(20年)	50,000,000	55,300,000	
第126回利付国債(20年)	105,000,000	114,726,150	
第127回利付国債(20年)	50,000,000	54,306,500	
第128回利付国債(20年)	65,000,000	70,704,400	
第129回利付国債(20年)	85,000,000	91,887,550	
第130回利付国債(20年)	150,000,000	162,292,500	

第131回利付国債(20年)	92,000,000	98,900,000	
第132回利付国債(20年)	135,000,000	145,145,250	
第133回利付国債(20年)	110,000,000	119,095,900	
第134回利付国債(20年)	120,000,000	129,993,600	
第135回利付国債(20年)	30,000,000	32,265,600	
第136回利付国債(20年)	220,000,000	234,993,000	
第137回利付国債(20年)	200,000,000	215,160,000	
第138回利付国債(20年)	120,000,000	127,228,800	
第139回利付国債(20年)	230,000,000	245,598,600	
第140回利付国債(20年)	318,000,000	342,155,280	
第141回利付国債(20年)	235,000,000	252,850,600	
第142回利付国債(20年)	165,000,000	178,853,400	
第143回利付国債(20年)	154,000,000	164,347,260	
第144回利付国債(20年)	330,000,000	349,324,800	
第145回利付国債(20年)	315,000,000	338,814,000	
第146回利付国債(20年)	195,000,000	209,584,050	
第147回利付国債(20年)	208,000,000	221,526,240	
第148回利付国債(20年)	220,000,000	231,833,800	
第149回利付国債(20年)	225,000,000	236,846,250	
第150回利付国債(20年)	250,000,000	260,392,500	
第151回利付国債(20年)	240,000,000	244,795,200	
第152回利付国債(20年)	250,000,000	254,482,500	
第153回利付国債(20年)	270,000,000	276,930,900	
第154回利付国債(20年)	230,000,000	233,003,800	
第155回利付国債(20年)	270,000,000	266,967,900	
第156回利付国債(20年)	160,000,000	147,193,600	
第157回利付国債(20年)	220,000,000	196,603,000	
第158回利付国債(20年)	230,000,000	212,340,600	
第159回利付国債(20年)	210,000,000	195,447,000	
第160回利付国債(20年)	210,000,000	197,076,600	
第161回利付国債(20年)	180,000,000	166,075,200	
第162回利付国債(20年)	210,000,000	192,939,600	
第163回利付国債(20年)	165,000,000	150,862,800	
第164回利付国債(20年)	255,000,000	228,926,250	
第165回利付国債(20年)	170,000,000	151,816,800	
第166回利付国債(20年)	150,000,000	137,193,000	
第167回利付国債(20年)	200,000,000	176,802,000	
第168回利付国債(20年)	140,000,000	121,249,800	
第169回利付国債(20年)	160,000,000	135,651,200	
第170回利付国債(20年)	140,000,000	118,041,000	
第171回利付国債(20年)	170,000,000	142,453,200	
第172回利付国債(20年)	230,000,000	194,904,300	

	第173回利付国債(20年)	190,000,000	160,130,100	
	第174回利付国債(20年)	200,000,000	167,630,000	
	第175回利付国債(20年)	180,000,000	152,649,000	
	第176回利付国債(20年)	190,000,000	160,373,300	
	第177回利付国債(20年)	200,000,000	165,048,000	
	第178回利付国債(20年)	220,000,000	183,792,400	
	第179回利付国債(20年)	220,000,000	182,901,400	
	第180回利付国債(20年)	190,000,000	165,999,200	
	第181回利付国債(20年)	190,000,000	168,233,600	
	第182回利付国債(20年)	200,000,000	182,644,000	
	第183回利付国債(20年)	190,000,000	181,974,400	
	第184回利付国債(20年)	200,000,000	181,388,000	
	第185回利付国債(20年)	230,000,000	207,788,900	
	第186回利付国債(20年)	200,000,000	193,076,000	
	第187回利付国債(20年)	170,000,000	158,069,400	
	第188回利付国債(20年)	120,000,000	117,184,800	
国債証券 合計		50,580,000,000	48,934,876,410	
地方債証券	第4回東京都公募公債(東京グリーンbond(5年))	100,000,000	99,711,000	
	第26回東京都公募公債(20年)	100,000,000	107,191,000	
	第32回東京都公募公債(5年)	200,000,000	199,534,000	
	令和3年度第6回北海道公募公債(5年)	100,000,000	99,231,000	
	第214回神奈川県公募公債	100,000,000	100,313,000	
	平成27年度第10回静岡県公募公債	200,000,000	200,528,000	
	平成22年度第1回福岡県公募公債(15年)	100,000,000	101,987,000	
	第144回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,250,416	
	第147回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,307,000	
	第165回共同発行市場公募地方債	200,000,000	198,750,000	
	平成28年度第1回長崎県公募公債	100,000,000	99,376,000	
	平成27年度第1回佐賀県公募公債	100,000,000	100,290,000	
	平成29年度第1回滋賀県公募公債	100,000,000	99,098,000	
	平成27年度第2回熊本県公募公債(10年)	100,000,000	100,287,000	
	第2回名古屋市定時償還公募公債(10年)	15,000,000	15,011,205	
	平成27年度第5回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	100,275,000	
	令和2年度第1回鹿児島県公募公債(5年)	100,000,000	99,665,000	
地方債証券 合計		1,915,000,000	1,921,804,621	
特殊債券	第5回政府保証新関西国際空港債券	100,000,000	99,325,000	
	第35回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	198,440,000	
	第60回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	99,017,000	
	第28回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,095,000	
	第43回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,221,000	

	第258回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,192,000	
	第273回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,441,000	
	第324回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	197,854,000	
	第351回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	98,615,000	
	第96回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	198,322,000	
	第97回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	99,202,000	
	第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	198,124,000	
	第52回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	98,497,000	
	第363回信金中金債（5年）	100,000,000	99,852,711	
	第395回信金中金債（5年）	100,000,000	98,859,000	
	第29回国際協力機構債券	100,000,000	100,268,000	
	第37回国際協力機構債券	100,000,000	99,229,000	
	特殊債券 合計	2,100,000,000	2,096,553,711	
社債券	第22回味の素株式会社無担保社債（特定社債間限定同順位特約付）	100,000,000	99,779,000	
	第25回味の素株式会社無担保社債（特定社債間限定同順位特約付）	100,000,000	99,356,000	
	第17回株式会社オリエントランド無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	98,534,000	
	第17回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）（ソーシャルボンド）	100,000,000	98,772,000	
	第14回株式会社小松製作所無担保社債（社債間限定同順位特約付）（グリーンボンド）	100,000,000	99,698,000	
	第16回NTTファイナンス株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	99,525,000	
	第184回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	99,749,000	
	第23回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	107,089,000	
	第510回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	99,362,000	
	第552回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	99,933,000	
	第400回中国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	98,909,000	
	第447回中国電力株式会社社債（一般担保付）（トランジションボンド）	100,000,000	98,929,000	
	第31回沖縄電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	99,805,000	
	第8回東京電力パワーグリッド株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	99,722,000	
	第28回東京瓦斯株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	100,000,000	105,032,000	
社債券 合計		1,500,000,000	1,504,194,000	
	合計	56,095,000,000	54,457,428,742	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

	（単位：円）	
	2023年12月15日現在	2024年 6月17日現在
資産の部		
流動資産		
預金	202,917,443	115,540,209
コール・ローン	83,791,558	86,680,360
国債証券	156,553,952,255	168,779,266,015
派生商品評価勘定	24,050	57,938
未収入金	-	80,078,161
未収利息	1,011,253,988	1,228,981,169
前払費用	77,691,070	75,582,557
流動資産合計	157,929,630,364	170,366,186,409
資産合計		
157,929,630,364		
170,366,186,409		
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	158,416	76,617
未払解約金	114,537,194	162,365,840
未払利息	10	-
流動負債合計	114,695,620	162,442,457
負債合計		
114,695,620		
162,442,457		
純資産の部		
元本等		
元本	56,559,461,172	55,620,468,481
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	101,255,473,572	114,583,275,471
元本等合計	157,814,934,744	170,203,743,952
純資産合計		
157,814,934,744		
170,203,743,952		
負債純資産合計		
157,929,630,364		
170,366,186,409		

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>（1）金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>（2）金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>（3）時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準 「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び第61条にしたがって処理しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2023年12月15日現在	2024年 6月17日現在
1. 期首	2023年 6月16日	2023年12月16日
期首元本額	58,234,773,394円	56,559,461,172円
期首からの追加設定元本額	1,779,240,850円	1,930,213,398円
期首からの一部解約元本額	3,454,553,072円	2,869,206,089円

	2023年12月15日現在	2024年 6月17日現在
元本の内訳		
インデックスファンド海外債券ヘッジなし(D C 専用)	19,265,198,903円	20,519,066,453円
D C インデックスバランス(株式 2 0)	424,170,404円	425,726,925円
D C インデックスバランス(株式 4 0)	594,863,816円	612,613,905円
D C インデックスバランス(株式 6 0)	851,180,829円	919,335,691円
D C インデックスバランス(株式 8 0)	769,679,137円	891,421,308円
財産 3 分法ファンド(不動産・債券・株式) 毎月分配型	14,495,459,509円	12,777,355,300円
世界の財産 3 分法ファンド(不動産・債券・株式) 毎月分配型	2,280,511,304円	2,150,070,500円
日興五大陸債券ファンド(毎月分配型)	12,021,092,590円	11,490,037,749円
財産 3 分法ファンド(不動産・債券・株式) 資産成長型	844,143,089円	832,913,390円
インデックス・アセットバランス・オープン(適格機関投資家向け)	140,319,112円	133,320,300円
財産 3 分法(適格機関投資家専用)	319,670,818円	347,202,276円
N i つみインデックスラップ世界 1 0 指数(均等型)	602,411円	935,868円
N i つみインデックスラップ世界 1 0 指数(安定成長型)	1,078,556円	1,681,178円
財産 3 分法ファンド(不動産・債券・株式) 奇数月分配型	724,046円	22,670,600円
国際分散型ファンド 4 0 (適格機関投資家向け)	492,848,150円	454,153,367円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式 2 0)	58,197,651円	55,820,759円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式 4 0)	85,976,760円	85,849,638円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式 6 0)	91,085,746円	94,391,712円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド(株式 8 0)	69,136,151円	73,921,509円
インデックスファンド海外債券(ヘッジなし) 1 年決算型	3,419,877,706円	3,385,962,218円
海外債券インデックスファンド(個人型年金向け)	333,644,484円	346,017,835円
計	56,559,461,172円	55,620,468,481円
2. 受益権の総数	56,559,461,172口	55,620,468,481口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額
(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

	自 2023年 6月16日 至 2023年12月15日	自 2023年12月16日 至 2024年 6月17日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	2023年12月15日現在	2024年 6月17日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左

	2023年12月15日現在	2024年 6月17日現在
	(3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(2023年12月15日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	8,766,367,299
合計	8,766,367,299

(2024年 6月17日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	7,678,581,991
合計	7,678,581,991

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、親投資信託の期首日から本書における開示対象ファンドの計算期間末日までに対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

(2023年12月15日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	52,665,800	-	52,689,850	24,050
	米ドル	52,665,800	-	52,689,850	24,050
	売建	43,857,000	-	44,015,416	158,416
	メキシコペソ	43,857,000	-	44,015,416	158,416
合計		96,522,800	-	96,705,266	134,366

(2024年 6月17日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	115,732,300	-	115,750,979	18,679
	米ドル	45,602,500	-	45,676,653	74,153
	メキシコペソ	40,461,480	-	40,403,542	57,938
	ユーロ	29,668,320	-	29,670,784	2,464
合計		115,732,300	-	115,750,979	18,679

(注) 1.時価の算定方法

- (1)本書における開示対象ファンドの計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・同計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物売買相場の仲値をもとに計算しております。
- ・同計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

- (2)本書における開示対象ファンドの計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については同計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

- (3)上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2023年12月15日現在		2024年 6月17日現在	
1口当たり純資産額	2,7902円	1口当たり純資産額	3,0601円
(1万口当たり純資産額)	(27,902円)	(1万口当たり純資産額)	(30,601円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	国債証券	US TREASURY N/B-2.875%-25/05/31	1,420,000.00	1,390,628.72	
		US TREASURY N/B-0.25%-25/05/31	3,820,000.00	3,649,200.16	
		US TREASURY N/B-2.875%-25/06/15	5,000,000.00	4,894,225.00	
		US TREASURY N/B-2.75%-25/06/30	1,370,000.00	1,338,653.03	
		US TREASURY N/B-3.0%-25/07/15	5,000,000.00	4,895,505.00	
		US TREASURY N/B-2.875%-25/07/31	1,440,000.00	1,407,036.96	
		US TREASURY N/B-0.25%-25/07/31	3,000,000.00	2,846,658.00	
		US TREASURY N/B-2.0%-25/08/15	4,730,000.00	4,571,838.26	
		US TREASURY N/B-2.75%-25/08/31	3,000,000.00	2,922,186.00	
		US TREASURY N/B-5.0%-25/08/31	5,000,000.00	4,999,900.00	
		US TREASURY N/B-3.0%-25/09/30	4,200,000.00	4,099,510.80	
		US TREASURY N/B-0.25%-25/09/30	1,570,000.00	1,479,049.90	
		US TREASURY N/B-4.25%-25/10/15	170,000.00	168,502.47	
		US TREASURY N/B-3.0%-25/10/31	1,400,000.00	1,364,834.80	
		US TREASURY N/B-0.25%-25/10/31	2,110,000.00	1,981,256.24	
		US TREASURY N/B-2.25%-25/11/15	3,440,000.00	3,317,178.24	
		US TREASURY N/B-2.875%-25/11/30	1,320,000.00	1,283,286.84	
		US TREASURY N/B-0.375%-25/11/30	3,420,000.00	3,206,113.20	
		US TREASURY N/B-4.875%-25/11/30	4,000,000.00	3,999,920.00	
		US TREASURY N/B-4.0%-25/12/15	1,510,000.00	1,491,360.56	
US TREASURY N/B-2.625%-25/12/31	2,000,000.00	1,934,920.00			

US TREASURY N/B-3.875%-26/01/15	1,150,000.00	1,133,311.20	
US TREASURY N/B-2.625%-26/01/31	1,850,000.00	1,787,127.75	
US TREASURY N/B-0.375%-26/01/31	2,370,000.00	2,207,292.39	
US TREASURY N/B-6.0%-26/02/15	1,800,000.00	1,838,952.00	
US TREASURY N/B-1.625%-26/02/15	3,310,000.00	3,143,205.79	
US TREASURY N/B-4.0%-26/02/15	3,000,000.00	2,962,089.00	
US TREASURY N/B-2.5%-26/02/28	1,790,000.00	1,723,573.10	
US TREASURY N/B-0.5%-26/02/28	3,650,000.00	3,397,277.65	
US TREASURY N/B-4.625%-26/02/28	2,820,000.00	2,812,507.26	
US TREASURY N/B-2.25%-26/03/31	4,490,000.00	4,299,525.22	
US TREASURY N/B-0.75%-26/03/31	2,400,000.00	2,237,390.40	
US TREASURY N/B-2.375%-26/04/30	1,050,000.00	1,006,317.90	
US TREASURY N/B-0.75%-26/04/30	2,740,000.00	2,547,610.90	
US TREASURY N/B-1.625%-26/05/15	4,840,000.00	4,570,015.12	
US TREASURY N/B-3.625%-26/05/15	6,750,000.00	6,618,159.00	
US TREASURY N/B-2.125%-26/05/31	2,740,000.00	2,610,384.30	
US TREASURY N/B-0.75%-26/05/31	2,800,000.00	2,596,232.80	
US TREASURY N/B-4.125%-26/06/15	3,000,000.00	2,968,827.00	
US TREASURY N/B-1.875%-26/06/30	2,000,000.00	1,893,202.00	
US TREASURY N/B-1.875%-26/07/31	960,000.00	906,936.96	
US TREASURY N/B-0.625%-26/07/31	3,260,000.00	2,998,880.52	
US TREASURY N/B-1.5%-26/08/15	4,000,000.00	3,744,840.00	
US TREASURY N/B-0.75%-26/08/31	3,000,000.00	2,760,000.00	
US TREASURY N/B-4.625%-26/09/15	2,600,000.00	2,600,507.00	
US TREASURY N/B-1.625%-26/09/30	1,620,000.00	1,517,230.44	
US TREASURY N/B-0.875%-26/09/30	2,000,000.00	1,841,600.00	
US TREASURY N/B-1.625%-26/10/31	250,000.00	233,554.50	
US TREASURY N/B-1.125%-26/10/31	3,950,000.00	3,647,809.20	
US TREASURY N/B-2.0%-26/11/15	3,040,000.00	2,863,418.56	
US TREASURY N/B-4.625%-26/11/15	3,200,000.00	3,204,499.20	
US TREASURY N/B-1.625%-26/11/30	2,400,000.00	2,238,561.60	
US TREASURY N/B-1.25%-26/11/30	2,210,000.00	2,043,041.13	
US TREASURY N/B-1.75%-26/12/31	2,000,000.00	1,868,906.00	
US TREASURY N/B-1.5%-27/01/31	4,000,000.00	3,705,780.00	
US TREASURY N/B-2.25%-27/02/15	2,680,000.00	2,530,399.72	
US TREASURY N/B-4.125%-27/02/15	1,880,000.00	1,862,337.40	
US TREASURY N/B-1.125%-27/02/28	1,390,000.00	1,272,175.26	
US TREASURY N/B-4.25%-27/03/15	2,300,000.00	2,286,478.30	
US TREASURY N/B-0.625%-27/03/31	670,000.00	603,209.04	
US TREASURY N/B-4.5%-27/04/15	2,430,000.00	2,432,276.91	
US TREASURY N/B-0.5%-27/04/30	1,380,000.00	1,234,506.60	
US TREASURY N/B-2.75%-27/04/30	1,430,000.00	1,364,894.96	

US TREASURY N/B-2.375%-27/05/15	3,530,000.00	3,330,745.62
US TREASURY N/B-4.5%-27/05/15	4,700,000.00	4,705,320.40
US TREASURY N/B-0.5%-27/05/31	1,600,000.00	1,427,000.00
US TREASURY N/B-2.625%-27/05/31	1,750,000.00	1,662,430.00
US TREASURY N/B-0.5%-27/06/30	2,600,000.00	2,313,287.60
US TREASURY N/B-3.25%-27/06/30	5,000,000.00	4,834,275.00
US TREASURY N/B-0.375%-27/07/31	5,950,000.00	5,255,289.90
US TREASURY N/B-2.75%-27/07/31	930,000.00	884,916.39
US TREASURY N/B-2.25%-27/08/15	2,960,000.00	2,772,282.72
US TREASURY N/B-0.5%-27/08/31	2,900,000.00	2,564,687.50
US TREASURY N/B-0.375%-27/09/30	4,090,000.00	3,592,406.51
US TREASURY N/B-0.5%-27/10/31	3,640,000.00	3,200,637.44
US TREASURY N/B-4.125%-27/10/31	800,000.00	793,359.20
US TREASURY N/B-6.125%-27/11/15	1,400,000.00	1,478,940.40
US TREASURY N/B-2.25%-27/11/15	3,020,000.00	2,817,445.58
US TREASURY N/B-0.625%-27/11/30	220,000.00	193,819.12
US TREASURY N/B-3.875%-27/11/30	2,320,000.00	2,283,070.24
US TREASURY N/B-0.625%-27/12/31	2,410,000.00	2,117,315.14
US TREASURY N/B-0.75%-28/01/31	2,850,000.00	2,508,832.20
US TREASURY N/B-3.5%-28/01/31	1,450,000.00	1,408,651.80
US TREASURY N/B-2.75%-28/02/15	4,000,000.00	3,783,512.00
US TREASURY N/B-1.125%-28/02/29	3,830,000.00	3,411,913.37
US TREASURY N/B-4.0%-28/02/29	2,650,000.00	2,618,271.55
US TREASURY N/B-1.25%-28/03/31	960,000.00	857,361.60
US TREASURY N/B-1.25%-28/04/30	3,370,000.00	3,003,445.10
US TREASURY N/B-3.5%-28/04/30	3,000,000.00	2,912,049.00
US TREASURY N/B-2.875%-28/05/15	2,440,000.00	2,313,376.20
US TREASURY N/B-1.25%-28/05/31	4,300,000.00	3,824,983.30
US TREASURY N/B-3.625%-28/05/31	1,020,000.00	994,439.82
US TREASURY N/B-1.25%-28/06/30	3,300,000.00	2,928,555.30
US TREASURY N/B-4.0%-28/06/30	200,000.00	197,718.60
US TREASURY N/B-1.0%-28/07/31	2,920,000.00	2,558,991.64
US TREASURY N/B-4.125%-28/07/31	5,950,000.00	5,910,486.05
US TREASURY N/B-2.875%-28/08/15	4,200,000.00	3,971,952.60
US TREASURY N/B-1.125%-28/08/31	2,960,000.00	2,601,848.88
US TREASURY N/B-1.25%-28/09/30	3,700,000.00	3,262,286.30
US TREASURY N/B-4.625%-28/09/30	2,400,000.00	2,430,513.60
US TREASURY N/B-1.375%-28/10/31	3,800,000.00	3,363,220.40
US TREASURY N/B-4.875%-28/10/31	2,100,000.00	2,148,684.30
US TREASURY N/B-5.25%-28/11/15	1,070,000.00	1,112,841.73
US TREASURY N/B-3.125%-28/11/15	2,610,000.00	2,488,674.15
US TREASURY N/B-1.5%-28/11/30	4,930,000.00	4,380,285.28
US TREASURY N/B-4.375%-28/11/30	1,050,000.00	1,054,490.85

US TREASURY N/B-1.375%-28/12/31	870,000.00	767,162.52
US TREASURY N/B-4.0%-29/01/31	2,700,000.00	2,670,308.10
US TREASURY N/B-2.625%-29/02/15	4,590,000.00	4,274,074.89
US TREASURY N/B-4.25%-29/02/28	5,000,000.00	5,001,070.00
US TREASURY N/B-2.375%-29/03/31	4,630,000.00	4,255,979.34
US TREASURY N/B-2.875%-29/04/30	2,000,000.00	1,879,804.00
US TREASURY N/B-2.375%-29/05/15	4,810,000.00	4,414,959.51
US TREASURY N/B-3.25%-29/06/30	4,980,000.00	4,755,900.00
US TREASURY N/B-1.625%-29/08/15	1,670,000.00	1,471,817.76
US TREASURY N/B-3.875%-29/09/30	325,000.00	319,388.55
US TREASURY N/B-4.0%-29/10/31	1,920,000.00	1,898,323.20
US TREASURY N/B-1.75%-29/11/15	7,190,000.00	6,345,735.82
US TREASURY N/B-1.5%-30/02/15	4,340,000.00	3,749,521.30
US TREASURY N/B-4.0%-30/02/28	1,650,000.00	1,630,985.40
US TREASURY N/B-3.625%-30/03/31	2,550,000.00	2,471,505.90
US TREASURY N/B-6.25%-30/05/15	1,060,000.00	1,171,465.36
US TREASURY N/B-0.625%-30/05/15	4,590,000.00	3,735,915.75
US TREASURY N/B-3.75%-30/05/31	710,000.00	692,374.25
US TREASURY N/B-4.0%-30/07/31	4,900,000.00	4,841,332.30
US TREASURY N/B-0.625%-30/08/15	5,090,000.00	4,107,986.30
US TREASURY N/B-4.625%-30/09/30	800,000.00	817,577.60
US TREASURY N/B-4.875%-30/10/31	3,000,000.00	3,108,513.00
US TREASURY N/B-0.875%-30/11/15	5,910,000.00	4,817,571.96
US TREASURY N/B-4.375%-30/11/30	3,000,000.00	3,026,190.00
US TREASURY N/B-5.375%-31/02/15	560,000.00	600,709.20
US TREASURY N/B-1.125%-31/02/15	3,300,000.00	2,723,143.50
US TREASURY N/B-4.25%-31/02/28	1,000,000.00	1,002,265.00
US TREASURY N/B-1.625%-31/05/15	6,020,000.00	5,097,946.70
US TREASURY N/B-1.25%-31/08/15	5,470,000.00	4,480,695.80
US TREASURY N/B-1.375%-31/11/15	6,530,000.00	5,362,762.50
US TREASURY N/B-1.875%-32/02/15	5,870,000.00	4,981,698.77
US TREASURY N/B-2.875%-32/05/15	4,800,000.00	4,372,310.40
US TREASURY N/B-2.75%-32/08/15	5,100,000.00	4,590,096.90
US TREASURY N/B-4.125%-32/11/15	6,110,000.00	6,074,317.60
US TREASURY N/B-3.5%-33/02/15	2,610,000.00	2,475,063.00
US TREASURY N/B-3.375%-33/05/15	1,680,000.00	1,575,720.72
US TREASURY N/B-3.875%-33/08/15	3,330,000.00	3,243,170.25
US TREASURY N/B-4.5%-33/11/15	5,540,000.00	5,660,749.84
US TREASURY N/B-4.0%-34/02/15	2,000,000.00	1,966,718.00
US TREASURY N/B-4.5%-36/02/15	800,000.00	827,812.00
US TREASURY N/B-5.0%-37/05/15	750,000.00	811,259.25
US TREASURY N/B-4.375%-38/02/15	670,000.00	681,855.65

US TREASURY N/B-4.5%-38/05/15	720,000.00	741,402.72
US TREASURY N/B-3.5%-39/02/15	800,000.00	735,608.80
US TREASURY N/B-4.25%-39/05/15	1,450,000.00	1,447,281.25
US TREASURY N/B-4.5%-39/08/15	1,420,000.00	1,456,498.26
US TREASURY N/B-4.375%-39/11/15	750,000.00	757,983.00
US TREASURY N/B-4.625%-40/02/15	680,000.00	706,057.60
US TREASURY N/B-4.375%-40/05/15	1,590,000.00	1,603,290.81
US TREASURY N/B-1.125%-40/05/15	3,700,000.00	2,340,538.60
US TREASURY N/B-3.875%-40/08/15	1,440,000.00	1,364,878.08
US TREASURY N/B-1.125%-40/08/15	3,000,000.00	1,879,218.00
US TREASURY N/B-4.25%-40/11/15	1,010,000.00	1,000,018.17
US TREASURY N/B-1.375%-40/11/15	3,100,000.00	2,013,787.90
US TREASURY N/B-4.75%-41/02/15	1,500,000.00	1,574,002.50
US TREASURY N/B-1.875%-41/02/15	4,200,000.00	2,953,452.60
US TREASURY N/B-4.375%-41/05/15	870,000.00	872,089.74
US TREASURY N/B-2.25%-41/05/15	4,900,000.00	3,641,596.70
US TREASURY N/B-3.75%-41/08/15	960,000.00	887,211.84
US TREASURY N/B-1.75%-41/08/15	3,190,000.00	2,167,764.50
US TREASURY N/B-2.0%-41/11/15	3,000,000.00	2,116,464.00
US TREASURY N/B-3.125%-42/02/15	500,000.00	420,605.00
US TREASURY N/B-2.75%-42/08/15	800,000.00	630,593.60
US TREASURY N/B-2.75%-42/11/15	2,000,000.00	1,570,546.00
US TREASURY N/B-3.125%-43/02/15	1,765,000.00	1,463,569.77
US TREASURY N/B-2.875%-43/05/15	2,050,000.00	1,630,949.25
US TREASURY N/B-3.625%-43/08/15	1,950,000.00	1,734,661.50
US TREASURY N/B-3.75%-43/11/15	2,090,000.00	1,890,714.32
US TREASURY N/B-3.625%-44/02/15	1,080,000.00	958,119.84
US TREASURY N/B-3.375%-44/05/15	2,000,000.00	1,706,014.00
US TREASURY N/B-3.125%-44/08/15	2,150,000.00	1,760,226.50
US TREASURY N/B-3.0%-44/11/15	1,900,000.00	1,520,110.20
US TREASURY N/B-2.5%-45/02/15	2,120,000.00	1,551,823.04
US TREASURY N/B-3.0%-45/05/15	1,400,000.00	1,116,334.80
US TREASURY N/B-2.875%-45/08/15	1,390,000.00	1,082,733.55
US TREASURY N/B-3.0%-45/11/15	1,190,000.00	945,816.76
US TREASURY N/B-2.5%-46/02/15	1,300,000.00	942,093.10
US TREASURY N/B-2.5%-46/05/15	1,500,000.00	1,083,631.50
US TREASURY N/B-2.25%-46/08/15	1,650,000.00	1,132,891.65
US TREASURY N/B-2.875%-46/11/15	540,000.00	417,086.28
US TREASURY N/B-3.0%-47/02/15	1,720,000.00	1,356,044.56
US TREASURY N/B-3.0%-47/05/15	1,530,000.00	1,204,634.79
US TREASURY N/B-2.75%-47/08/15	1,700,000.00	1,276,128.80
US TREASURY N/B-2.75%-47/11/15	1,740,000.00	1,303,775.04
US TREASURY N/B-3.0%-48/02/15	2,750,000.00	2,155,848.75

		US TREASURY N/B-3.125%-48/05/15	2,400,000.00	1,923,842.40
		US TREASURY N/B-3.0%-48/08/15	4,100,000.00	3,208,086.00
		US TREASURY N/B-3.375%-48/11/15	2,950,000.00	2,469,931.75
		US TREASURY N/B-3.0%-49/02/15	3,300,000.00	2,579,798.10
		US TREASURY N/B-2.875%-49/05/15	3,000,000.00	2,288,319.00
		US TREASURY N/B-2.25%-49/08/15	2,950,000.00	1,973,042.60
		US TREASURY N/B-2.375%-49/11/15	3,100,000.00	2,129,613.20
		US TREASURY N/B-2.0%-50/02/15	3,700,000.00	2,327,385.10
		US TREASURY N/B-1.25%-50/05/15	2,450,000.00	1,261,941.10
		US TREASURY N/B-1.375%-50/08/15	2,920,000.00	1,551,019.32
		US TREASURY N/B-1.625%-50/11/15	3,000,000.00	1,703,496.00
		US TREASURY N/B-1.875%-51/02/15	4,750,000.00	2,876,158.25
		US TREASURY N/B-2.375%-51/05/15	4,100,000.00	2,795,363.60
		US TREASURY N/B-2.0%-51/08/15	2,000,000.00	1,245,428.00
		US TREASURY N/B-1.875%-51/11/15	1,400,000.00	843,718.40
		US TREASURY N/B-2.25%-52/02/15	2,000,000.00	1,321,014.00
		US TREASURY N/B-2.875%-52/05/15	600,000.00	455,566.20
		US TREASURY N/B-3.0%-52/08/15	1,100,000.00	856,946.20
		US TREASURY N/B-4.0%-52/11/15	1,500,000.00	1,412,724.00
		US TREASURY N/B-3.625%-53/02/15	2,900,000.00	2,550,866.10
		US TREASURY N/B-3.625%-53/05/15	2,150,000.00	1,891,370.05
		US TREASURY N/B-4.125%-53/08/15	1,500,000.00	1,443,750.00
		US TREASURY N/B-4.75%-53/11/15	1,500,000.00	1,603,242.00
		US TREASURY N/B-4.25%-54/02/15	1,000,000.00	984,218.00
		US TREASURY N/B-4.625%-54/05/15	1,500,000.00	1,571,250.00
米ドル小計			566,390,000.00	506,767,167.57 (79,831,031,907)
加ドル	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-25/06/01	950,000.00	932,417.40
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-25/08/01	510,000.00	506,189.28
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-25/09/01	1,755,000.00	1,682,146.44
		CANADIAN GOVERNMENT-3.0%-25/10/01	430,000.00	424,182.10
		CANADIAN GOVERNMENT-4.5%-25/11/01	450,000.00	452,538.45
		CANADIAN GOVERNMENT-4.5%-26/02/01	620,000.00	625,325.80
		CANADIAN GOVERNMENT-0.25%-26/03/01	995,000.00	936,732.80
		CANADIAN GOVERNMENT-3.0%-26/04/01	700,000.00	689,973.90
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-26/05/01	870,000.00	872,617.83
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-26/06/01	670,000.00	642,012.76
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-26/09/01	990,000.00	934,124.40
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-27/03/01	520,000.00	489,456.24
		CANADIAN GOVERNMENT-1.0%-27/06/01	750,000.00	698,807.25
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-27/09/01	620,000.00	607,179.64
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-28/03/01	580,000.00	582,222.56

		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-28/06/01	897,000.00	854,085.72	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-28/09/01	630,000.00	627,706.80	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-29/03/01	950,000.00	978,450.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-29/06/01	410,000.00	456,998.30	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-29/06/01	364,000.00	348,303.22	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-29/09/01	50,000.00	50,499.00	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.25%-29/12/01	120,000.00	114,485.52	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.25%-30/06/01	1,848,000.00	1,649,404.68	
		CANADIAN GOVERNMENT-0.5%-30/12/01	1,205,000.00	1,014,191.86	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-31/06/01	1,746,000.00	1,557,025.18	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.5%-31/12/01	1,520,000.00	1,344,646.72	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-32/06/01	1,070,000.00	976,239.11	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.5%-32/12/01	890,000.00	840,524.90	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.75%-33/06/01	710,000.00	845,661.83	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-33/06/01	500,000.00	480,148.50	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.25%-33/12/01	800,000.00	798,489.60	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.0%-34/06/01	420,000.00	410,212.74	
		CANADIAN GOVERNMENT-5.0%-37/06/01	290,000.00	341,687.57	
		CANADIAN GOVERNMENT-4.0%-41/06/01	550,000.00	599,628.70	
		CANADIAN GOVERNMENT-3.5%-45/12/01	520,000.00	538,044.52	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-48/12/01	650,000.00	596,035.05	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.0%-51/12/01	2,123,000.00	1,645,847.25	
		CANADIAN GOVERNMENT-1.75%-53/12/01	1,241,000.00	894,893.78	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-55/12/01	600,000.00	545,687.40	
		CANADIAN GOVERNMENT-2.75%-64/12/01	335,000.00	303,930.09	
		加ドル小計	31,849,000.00	29,888,755.49 (3,427,941,367)	
メキシコ ペソ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT-5.75%- 26/03/05	24,250,000.00	22,317,578.12	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.0%-26/09/03	3,000,000.00	2,775,000.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-5.5%-27/03/04	13,350,000.00	11,789,718.75	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-27/06/03	20,500,000.00	18,924,062.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/03/01	4,900,000.00	4,579,968.75	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-29/05/31	14,120,000.00	13,197,787.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 31/05/29	19,900,000.00	17,549,312.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.5%-33/05/26	12,800,000.00	10,860,000.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%- 34/11/23	6,000,000.00	5,090,625.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-35/05/24	1,500,000.00	1,294,252.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-10.0%- 36/11/20	4,400,000.00	4,367,000.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.5%-38/11/18	11,170,000.00	9,787,712.50	

		MEX BONOS DESARR FIX RT-7.75%-42/11/13	14,100,000.00	11,271,187.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-47/11/07	13,570,000.00	10,957,775.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT-8.0%-53/07/31	9,550,000.00	7,625,078.12	
		メキシコペソ小計	173,110,000.00	152,387,058.74 (1,296,951,018)	
ユーロ	国債証券	BELGIUM KINGDOM-0.65%-71/06/22	270,000.00	113,175.90	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-25/06/22	1,020,000.00	994,328.64	
		BELGIUM KINGDOM-4.5%-26/03/28	505,000.00	517,645.20	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-26/06/22	772,000.00	742,282.63	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-27/06/22	780,000.00	734,132.10	
		BELGIUM KINGDOM-0.0%-27/10/22	545,000.00	496,372.92	
		BELGIUM KINGDOM-5.5%-28/03/28	970,000.00	1,062,214.02	
		BELGIUM KINGDOM-0.8%-28/06/22	795,000.00	735,890.95	
		BELGIUM KINGDOM-0.9%-29/06/22	950,000.00	867,180.90	
		BELGIUM KINGDOM-2.7%-29/10/22	152,000.00	151,171.14	
		BELGIUM KINGDOM-0.1%-30/06/22	730,000.00	621,983.36	
		BELGIUM KINGDOM-1.0%-31/06/22	855,000.00	754,948.75	
		BELGIUM KINGDOM-0.0%-31/10/22	750,000.00	609,605.25	
		BELGIUM KINGDOM-4.0%-32/03/28	475,000.00	510,925.20	
		BELGIUM KINGDOM-0.35%-32/06/22	675,000.00	552,555.00	
		BELGIUM KINGDOM-1.25%-33/04/22	525,000.00	457,335.90	
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-33/06/22	476,000.00	477,378.96	
		BELGIUM KINGDOM-3.0%-34/06/22	543,000.00	542,040.51	
		BELGIUM KINGDOM-2.85%-34/10/22	50,000.00	49,097.15	
		BELGIUM KINGDOM-5.0%-35/03/28	974,000.00	1,142,086.10	
		BELGIUM KINGDOM-1.45%-37/06/22	340,000.00	276,698.80	
		BELGIUM KINGDOM-1.9%-38/06/22	415,000.00	352,418.83	
		BELGIUM KINGDOM-2.75%-39/04/22	160,000.00	150,225.60	
		BELGIUM KINGDOM-0.4%-40/06/22	405,000.00	259,675.87	
		BELGIUM KINGDOM-4.25%-41/03/28	992,000.00	1,107,377.53	
		BELGIUM KINGDOM-3.75%-45/06/22	435,000.00	457,016.65	
		BELGIUM KINGDOM-1.6%-47/06/22	538,000.00	383,606.37	
		BELGIUM KINGDOM-1.7%-50/06/22	626,000.00	439,792.54	
		BELGIUM KINGDOM-1.4%-53/06/22	485,000.00	304,063.47	
		BELGIUM KINGDOM-3.3%-54/06/22	433,000.00	416,646.87	
		BELGIUM KINGDOM-3.5%-55/06/22	235,000.00	233,637.00	
		BELGIUM KINGDOM-2.25%-57/06/22	412,000.00	315,317.19	
		BELGIUM KINGDOM-2.15%-66/06/22	446,000.00	329,695.24	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%-71/10/31	345,000.00	169,418.11	
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.65%-25/07/30	1,205,000.00	1,222,319.46	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.15%- 25/10/31	1,455,000.00	1,435,094.14	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%- 26/01/31	1,455,000.00	1,384,477.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%- 26/04/30	1,055,000.00	1,033,768.12	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.8%- 26/05/31	485,000.00	482,341.71	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.9%- 26/07/30	1,360,000.00	1,437,972.88	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.3%- 26/10/31	1,640,000.00	1,576,994.48	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%- 27/01/31	755,000.00	698,383.30	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.5%- 27/04/30	1,275,000.00	1,224,063.75	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.5%- 27/05/31	120,000.00	118,307.88	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.8%- 27/07/30	1,315,000.00	1,231,138.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%- 27/10/31	1,300,000.00	1,238,668.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.0%- 28/01/31	1,125,000.00	1,012,513.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%- 28/04/30	1,270,000.00	1,199,803.29	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.4%- 28/07/30	1,275,000.00	1,200,597.37	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%- 28/10/31	1,020,000.00	1,111,614.36	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-6.0%- 29/01/31	1,355,000.00	1,533,494.15	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.45%- 29/04/30	1,275,000.00	1,190,739.07	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.5%- 29/05/31	430,000.00	440,489.42	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.8%- 29/07/30	1,035,000.00	930,082.05	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.6%- 29/10/31	1,280,000.00	1,132,436.48	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.5%- 30/04/30	1,205,000.00	1,047,347.44	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.95%- 30/07/30	1,180,000.00	1,113,699.34	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.25%- 30/10/31	1,180,000.00	1,062,422.44	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.1%- 31/04/30	1,245,000.00	1,023,162.16	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.5%- 31/10/31	1,015,000.00	846,503.91	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.7%- 32/04/30	1,270,000.00	1,060,481.75	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.75%-32/07/30	1,170,000.00	1,389,338.73
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.55%-32/10/31	1,045,000.00	1,000,036.78
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.15%-33/04/30	1,082,000.00	1,078,432.64
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.35%-33/07/30	1,165,000.00	1,087,692.93
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.55%-33/10/31	1,030,000.00	1,055,404.94
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.25%-34/04/30	553,000.00	551,333.25
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.85%-35/07/30	995,000.00	858,030.29
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.2%-37/01/31	1,055,000.00	1,136,272.98
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-0.85%-37/07/30	670,000.00	485,463.24
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.9%-39/07/30	340,000.00	351,517.16
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.9%-40/07/30	1,045,000.00	1,205,149.38
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.2%-40/10/31	1,000,000.00	701,962.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.7%-41/07/30	1,265,000.00	1,434,421.45
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.0%-42/07/30	390,000.00	254,607.60
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%-43/07/30	300,000.00	288,481.50
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-5.15%-44/10/31	710,000.00	854,056.87
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.9%-46/10/31	980,000.00	856,855.16
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-2.7%-48/10/31	985,000.00	819,544.62
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.0%-50/10/31	1,170,000.00	636,997.14
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-1.9%-52/10/31	743,000.00	499,370.30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-4.0%-54/10/31	150,000.00	152,670.75
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO-3.45%-66/07/30	848,000.00	771,203.42
BUNDESobligation-0.0%-25/10/10	1,650,000.00	1,587,611.85
BUNDESobligation-0.0%-26/04/10	1,600,000.00	1,523,646.40
BUNDESobligation-0.0%-26/10/09	800,000.00	753,512.00
BUNDESobligation-0.0%-27/04/16	1,050,000.00	978,319.65
BUNDESobligation-1.3%-27/10/15	1,130,000.00	1,088,901.90
BUNDESobligation-2.2%-28/04/13	750,000.00	743,777.25
BUNDESobligation-2.4%-28/10/19	685,000.00	685,089.73

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 25/08/15	2,070,000.00	2,021,245.29	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 26/02/15	1,820,000.00	1,752,237.76	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 26/08/15	1,910,000.00	1,805,393.12	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 27/02/15	1,315,000.00	1,238,606.39	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.5%- 27/07/04	910,000.00	1,014,515.32	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 27/08/15	1,770,000.00	1,665,596.55	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 27/11/15	1,295,000.00	1,192,406.21	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.625%- 28/01/04	650,000.00	719,425.85	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.5%- 28/02/15	1,690,000.00	1,578,573.23	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 28/07/04	970,000.00	1,057,029.37	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 28/08/15	1,670,000.00	1,532,325.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 28/11/15	1,180,000.00	1,065,416.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.25%- 29/02/15	1,705,000.00	1,550,813.44	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 29/08/15	1,760,000.00	1,565,016.64	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.1%- 29/11/15	620,000.00	612,446.54	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-6.25%- 30/01/04	660,000.00	792,201.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 30/02/15	1,360,000.00	1,196,562.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 30/08/15	1,800,000.00	1,567,780.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 30/08/15	740,000.00	644,971.42	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-5.5%- 31/01/04	1,110,000.00	1,319,649.03	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 31/02/15	1,310,000.00	1,128,077.68	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 31/08/15	1,565,000.00	1,333,054.48	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 31/08/15	400,000.00	340,936.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 32/02/15	1,323,000.00	1,113,006.82	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.7%- 32/08/15	1,380,000.00	1,319,648.46	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.3%- 33/02/15	1,770,000.00	1,767,973.35	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.3%- 33/02/15	170,000.00	169,860.26
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.6%- 33/08/15	1,310,000.00	1,338,623.50
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.2%- 34/02/15	850,000.00	838,808.90
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 34/07/04	1,300,000.00	1,574,300.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 35/05/15	1,030,000.00	795,370.12
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 36/05/15	1,000,000.00	751,197.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.0%- 37/01/04	1,790,000.00	2,084,787.94
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.0%- 38/05/15	115,000.00	94,974.82
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.25%- 39/07/04	1,135,000.00	1,378,733.30
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-4.75%- 40/07/04	1,165,000.00	1,504,321.39
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-3.25%- 42/07/04	955,000.00	1,051,222.93
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 44/07/04	1,635,000.00	1,622,737.50
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 46/08/15	1,697,000.00	1,686,911.33
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.25%- 48/08/15	2,040,000.00	1,576,012.20
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 50/08/15	1,630,000.00	857,777.72
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 50/08/15	640,000.00	338,248.32
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-0.0%- 52/08/15	900,000.00	452,684.70
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.8%- 53/08/15	1,040,000.00	888,737.20
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-1.8%- 53/08/15	500,000.00	428,144.50
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND-2.5%- 54/08/15	345,000.00	344,180.62
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-2.8%-25/06/12	910,000.00	906,648.47
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-3.1%-25/12/12	420,000.00	420,875.70
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN-2.5%-26/03/19	280,000.00	278,414.08
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%- 72/03/01	220,000.00	133,768.80
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%- 25/06/01	1,300,000.00	1,275,670.50
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.85%- 25/07/01	1,000,000.00	983,300.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.6%- 25/09/29	85,000.00	85,078.45
	1,100,000.00	1,086,356.70

BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 25/11/15			
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%- 25/12/01	1,085,000.00	1,063,462.75	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 26/01/15	810,000.00	810,710.37	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.5%- 26/02/01	850,000.00	811,075.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%- 26/03/01	1,330,000.00	1,353,620.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%- 26/04/01	1,020,000.00	960,574.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.8%- 26/04/15	950,000.00	956,483.75	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.6%- 26/06/01	970,000.00	937,682.51	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.1%- 26/07/15	950,000.00	926,441.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.0%- 26/08/01	870,000.00	810,630.33	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.85%- 26/09/15	445,000.00	449,592.84	
BUONI POLIENNALI DEL TES-7.25%- 26/11/01	720,000.00	783,576.72	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.25%- 26/12/01	1,080,000.00	1,027,890.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.85%- 27/01/15	1,005,000.00	944,360.31	
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.1%- 27/04/01	410,000.00	385,896.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.2%- 27/06/01	1,160,000.00	1,123,773.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.05%- 27/08/01	995,000.00	957,688.49	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 27/09/15	775,000.00	719,086.85	
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.5%- 27/11/01	1,440,000.00	1,585,118.88	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.65%- 27/12/01	950,000.00	929,183.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.0%- 28/02/01	1,365,000.00	1,303,594.11	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.25%- 28/03/15	1,140,000.00	1,017,239.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.4%- 28/04/01	150,000.00	150,241.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.5%- 28/07/15	1,130,000.00	1,008,941.97	
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.8%- 28/08/01	650,000.00	660,428.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 28/09/01	1,330,000.00	1,401,132.39	

BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%- 28/12/01	1,030,000.00	1,006,801.31
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.1%- 29/02/01	735,000.00	756,724.39
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.45%- 29/02/15	605,000.00	529,238.87
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%- 29/06/15	305,000.00	296,409.67
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.0%- 29/08/01	1,945,000.00	1,907,766.86
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.25%- 29/11/01	1,750,000.00	1,906,822.75
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.85%- 29/12/15	535,000.00	544,940.83
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 30/03/01	1,500,000.00	1,503,807.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.35%- 30/04/01	1,075,000.00	956,083.50
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.7%- 30/06/15	540,000.00	544,888.62
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 30/08/01	897,000.00	771,001.10
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 30/11/15	585,000.00	599,492.79
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%- 30/12/01	1,287,000.00	1,146,837.97
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.5%- 31/02/15	235,000.00	233,762.72
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.9%- 31/04/01	1,295,000.00	1,089,063.92
BUONI POLIENNALI DEL TES-6.0%- 31/05/01	1,515,000.00	1,740,533.50
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.6%- 31/08/01	1,120,000.00	911,858.08
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 31/10/30	290,000.00	297,589.59
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 31/12/01	1,010,000.00	836,259.80
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.65%- 32/03/01	1,250,000.00	1,086,211.25
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 32/06/01	1,130,000.00	921,678.85
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.5%- 32/12/01	670,000.00	612,429.58
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.75%- 33/02/01	1,425,000.00	1,632,544.12
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.4%- 33/05/01	865,000.00	907,212.86
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%- 33/09/01	1,195,000.00	1,075,203.64
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.35%- 33/11/01	700,000.00	729,739.50

BUONI POLIENNALI DEL TES-4.2%- 34/03/01	705,000.00	725,480.25
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 34/08/01	1,460,000.00	1,599,159.90
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.35%- 35/03/01	980,000.00	932,772.82
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 35/04/30	400,000.00	404,053.20
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.45%- 36/03/01	770,000.00	591,013.50
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.25%- 36/09/01	965,000.00	805,858.95
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.0%- 37/02/01	1,825,000.00	1,832,482.50
BUONI POLIENNALI DEL TES-0.95%- 37/03/01	400,000.00	279,548.40
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.05%- 37/10/30	290,000.00	290,443.12
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%- 38/03/01	200,000.00	182,542.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.95%- 38/09/01	785,000.00	689,301.43
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 39/08/01	1,200,000.00	1,311,018.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.15%- 39/10/01	350,000.00	348,757.15
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.1%- 40/03/01	810,000.00	711,734.04
BUONI POLIENNALI DEL TES-5.0%- 40/09/01	1,070,000.00	1,168,660.42
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.8%- 41/03/01	730,000.00	523,778.65
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.45%- 43/09/01	500,000.00	511,102.00
BUONI POLIENNALI DEL TES-4.75%- 44/09/01	935,000.00	995,891.87
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.5%- 45/04/30	440,000.00	277,257.20
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.25%- 46/09/01	820,000.00	704,063.48
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.7%- 47/03/01	970,000.00	755,286.62
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.45%- 48/03/01	915,000.00	805,177.12
BUONI POLIENNALI DEL TES-3.85%- 49/09/01	650,000.00	606,563.75
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.45%- 50/09/01	870,000.00	625,456.92
BUONI POLIENNALI DEL TES-1.7%- 51/09/01	750,000.00	453,893.25
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.15%- 52/09/01	280,000.00	184,544.36

BUONI POLIENNALI DEL TES-4.5%-53/10/01	735,000.00	750,961.99
BUONI POLIENNALI DEL TES-2.8%-67/03/01	500,000.00	363,612.50
FINNISH GOVERNMENT-4.0%-25/07/04	332,000.00	334,723.39
FINNISH GOVERNMENT-0.875%-25/09/15	247,000.00	240,225.03
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-26/04/15	245,000.00	234,407.91
FINNISH GOVERNMENT-0.0%-26/09/15	180,000.00	168,706.26
FINNISH GOVERNMENT-1.375%-27/04/15	170,000.00	163,149.51
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-27/09/15	350,000.00	325,224.55
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-28/07/04	330,000.00	329,776.26
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-28/09/15	270,000.00	245,362.50
FINNISH GOVERNMENT-2.875%-29/04/15	180,000.00	180,404.64
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-29/09/15	375,000.00	333,365.62
FINNISH GOVERNMENT-0.0%-30/09/15	292,000.00	245,387.45
FINNISH GOVERNMENT-0.75%-31/04/15	365,000.00	318,412.86
FINNISH GOVERNMENT-0.125%-31/09/15	200,000.00	164,713.40
FINNISH GOVERNMENT-1.5%-32/09/15	230,000.00	206,493.31
FINNISH GOVERNMENT-3.0%-33/09/15	110,000.00	110,323.18
FINNISH GOVERNMENT-1.125%-34/04/15	325,000.00	274,608.10
FINNISH GOVERNMENT-3.0%-34/09/15	140,000.00	140,010.64
FINNISH GOVERNMENT-0.125%-36/04/15	278,000.00	197,758.35
FINNISH GOVERNMENT-2.75%-38/04/15	210,000.00	200,985.96
FINNISH GOVERNMENT-0.25%-40/09/15	210,000.00	133,818.51
FINNISH GOVERNMENT-2.625%-42/07/04	277,000.00	257,383.69
FINNISH GOVERNMENT-0.5%-43/04/15	235,000.00	147,939.31
FINNISH GOVERNMENT-1.375%-47/04/15	260,000.00	187,570.76
FINNISH GOVERNMENT-0.125%-52/04/15	250,000.00	115,895.75
FINNISH GOVERNMENT-2.95%-55/04/15	110,000.00	106,080.70
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-72/05/25	515,000.00	191,390.48
FRANCE (GOVT OF)-6.0%-25/10/25	1,570,000.00	1,626,058.42
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-25/11/25	2,000,000.00	1,938,926.00
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-26/02/25	2,270,000.00	2,156,454.60
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-26/04/25	1,970,000.00	1,984,818.34
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-26/05/25	2,450,000.00	2,334,507.00
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-26/09/24	1,360,000.00	1,344,300.16
FRANCE (GOVT OF)-0.25%-26/11/25	2,520,000.00	2,358,392.40
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-27/02/25	2,005,000.00	1,852,622.00
FRANCE (GOVT OF)-1.0%-27/05/25	1,775,000.00	1,677,987.37
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-27/09/24	180,000.00	177,423.30
FRANCE (GOVT OF)-2.75%-27/10/25	3,020,000.00	2,998,615.38
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/02/25	1,275,000.00	1,178,448.07
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/05/25	3,765,000.00	3,463,001.82

FRANCE (GOVT OF)-0.75%-28/11/25	3,080,000.00	2,805,011.44
FRANCE (GOVT OF)-2.75%-29/02/25	305,000.00	302,447.15
FRANCE (GOVT OF)-5.5%-29/04/25	2,105,000.00	2,340,924.19
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-29/05/25	2,980,000.00	2,652,638.06
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-29/11/25	2,510,000.00	2,147,362.73
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-30/05/25	2,935,000.00	2,868,222.88
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-30/11/25	2,839,000.00	2,356,259.27
FRANCE (GOVT OF)-1.5%-31/05/25	2,940,000.00	2,675,620.50
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-31/11/25	2,605,000.00	2,093,773.96
FRANCE (GOVT OF)-0.0%-32/05/25	1,903,000.00	1,503,982.76
FRANCE (GOVT OF)-5.75%-32/10/25	1,655,000.00	1,977,862.36
FRANCE (GOVT OF)-2.0%-32/11/25	2,075,000.00	1,915,720.92
FRANCE (GOVT OF)-3.0%-33/05/25	1,260,000.00	1,252,050.66
FRANCE (GOVT OF)-3.5%-33/11/25	1,113,000.00	1,147,247.01
FRANCE (GOVT OF)-1.25%-34/05/25	2,305,000.00	1,939,811.93
FRANCE (GOVT OF)-4.75%-35/04/25	1,425,000.00	1,628,273.40
FRANCE (GOVT OF)-1.25%-36/05/25	2,555,000.00	2,058,474.07
FRANCE (GOVT OF)-1.25%-38/05/25	190,000.00	146,158.45
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-38/10/25	1,500,000.00	1,613,175.00
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-39/06/25	1,890,000.00	1,541,391.39
FRANCE (GOVT OF)-4.5%-41/04/25	2,780,000.00	3,167,907.30
FRANCE (GOVT OF)-2.5%-43/05/25	135,000.00	117,042.16
FRANCE (GOVT OF)-0.5%-44/06/25	1,050,000.00	610,493.10
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-45/05/25	1,430,000.00	1,386,645.26
FRANCE (GOVT OF)-2.0%-48/05/25	1,580,000.00	1,202,677.04
FRANCE (GOVT OF)-3.0%-49/06/25	248,000.00	228,587.05
FRANCE (GOVT OF)-1.5%-50/05/25	1,840,000.00	1,222,775.68
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-52/05/25	1,500,000.00	777,454.50
FRANCE (GOVT OF)-0.75%-53/05/25	1,320,000.00	668,401.80
FRANCE (GOVT OF)-3.0%-54/05/25	850,000.00	764,672.75
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-55/04/25	1,190,000.00	1,290,433.62
FRANCE (GOVT OF)-3.25%-55/05/25	400,000.00	375,987.60
FRANCE (GOVT OF)-4.0%-60/04/25	1,070,000.00	1,173,386.61
FRANCE (GOVT OF)-1.75%-66/05/25	945,000.00	607,755.01
IRISH TREASURY-1.0%-26/05/15	560,000.00	540,606.08
IRISH TREASURY-0.2%-27/05/15	327,000.00	304,080.57
IRISH TREASURY-0.9%-28/05/15	425,000.00	397,230.07
IRISH TREASURY-1.1%-29/05/15	463,000.00	430,270.99
IRISH TREASURY-2.4%-30/05/15	476,000.00	468,370.67
IRISH TREASURY-0.2%-30/10/18	282,000.00	241,697.12
IRISH TREASURY-1.35%-31/03/18	335,000.00	307,106.22
IRISH TREASURY-0.0%-31/10/18	405,000.00	332,299.66
IRISH TREASURY-0.35%-32/10/18	205,000.00	168,482.32

IRISH TREASURY-1.3%-33/05/15	238,000.00	210,470.06	
IRISH TREASURY-0.4%-35/05/15	250,000.00	192,183.75	
IRISH TREASURY-1.7%-37/05/15	365,000.00	314,620.51	
IRISH TREASURY-0.55%-41/04/22	185,000.00	124,110.02	
IRISH TREASURY-3.0%-43/10/18	170,000.00	167,516.64	
IRISH TREASURY-2.0%-45/02/18	521,000.00	435,803.47	
IRISH TREASURY-1.5%-50/05/15	461,000.00	330,597.39	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-25/07/15	940,000.00	911,533.98	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-26/01/15	455,000.00	435,068.72	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-26/07/15	870,000.00	830,954.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-27/01/15	740,000.00	691,031.98	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-27/07/15	820,000.00	774,503.94	
NETHERLANDS GOVERNMENT-5.5%-28/01/15	655,000.00	719,007.91	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.75%-28/07/15	911,000.00	846,746.25	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-29/01/15	590,000.00	524,694.67	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.25%-29/07/15	595,000.00	529,732.07	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-30/01/15	365,000.00	362,913.29	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-30/07/15	670,000.00	573,797.38	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-31/07/15	710,000.00	592,979.22	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-32/07/15	700,000.00	593,068.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/01/15	697,000.00	689,869.69	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-33/07/15	465,000.00	458,484.88	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.5%-34/07/15	290,000.00	284,501.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT-4.0%-37/01/15	935,000.00	1,053,046.55	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-38/01/15	395,000.00	270,400.01	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.5%-40/01/15	763,000.00	542,765.39	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.75%-42/01/15	902,000.00	1,017,032.06	
NETHERLANDS GOVERNMENT-3.25%-44/01/15	220,000.00	234,129.06	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.75%-47/01/15	919,000.00	916,517.78	
NETHERLANDS GOVERNMENT-0.0%-52/01/15	907,000.00	439,013.39	
NETHERLANDS GOVERNMENT-2.0%-54/01/15	539,000.00	458,138.67	
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.7%-71/04/20	180,000.00	81,609.30	
REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-86/11/02	173,000.00	105,241.09	
REPUBLIC OF AUSTRIA-2.1%-17/09/20	343,000.00	259,130.66	
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.85%-99/99/99	192,000.00	88,258.75	
REPUBLIC OF AUSTRIA-1.2%-25/10/20	680,000.00	663,450.84	
REPUBLIC OF AUSTRIA-4.85%-26/03/15	550,000.00	568,022.95	
REPUBLIC OF AUSTRIA-2.0%-26/07/15	170,000.00	167,016.67	
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-26/10/20	773,000.00	736,871.52	
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-27/04/20	685,000.00	642,487.53	
REPUBLIC OF AUSTRIA-6.25%-27/07/15	487,000.00	535,686.85	
REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-28/02/20	660,000.00	613,837.62	

		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-28/10/20	382,000.00	339,396.30
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.5%-29/02/20	715,000.00	644,964.32
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.9%-29/05/23	150,000.00	151,084.05
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-30/02/20	680,000.00	581,465.28
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.45%-30/10/20	155,000.00	160,607.43
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-31/02/20	745,000.00	617,127.45
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.9%-32/02/20	610,000.00	527,581.68
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.9%-33/02/20	650,000.00	648,069.50
		REPUBLIC OF AUSTRIA-2.4%-34/05/23	455,000.00	433,005.30
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.25%-36/10/20	270,000.00	192,702.78
		REPUBLIC OF AUSTRIA-4.15%-37/03/15	790,000.00	879,033.00
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.2%-39/07/15	53,000.00	53,456.33
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.0%-40/10/20	255,000.00	154,385.16
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-44/06/20	394,000.00	394,948.75
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.5%-47/02/20	503,000.00	371,490.14
		REPUBLIC OF AUSTRIA-1.85%-49/05/23	288,000.00	225,144.86
		REPUBLIC OF AUSTRIA-0.75%-51/03/20	455,000.00	264,046.05
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.15%-53/10/20	206,000.00	205,684.82
		REPUBLIC OF AUSTRIA-3.8%-62/01/26	245,000.00	281,185.76
ユーロ小計			331,673,000.00	308,551,630.10 (52,034,146,900)
英ポンド	国債証券	UK TREASURY-1.625%-71/10/22	760,000.00	355,908.00
		UK TREASURY-1.125%-73/10/22	513,000.00	191,319.75
		UK TREASURY-0.625%-25/06/07	813,000.00	782,392.17
		UK TREASURY-3.5%-25/10/22	1,490,000.00	1,467,013.77
		UK TREASURY-0.125%-26/01/30	710,000.00	665,666.18
		UK TREASURY-1.5%-26/07/22	820,000.00	775,841.36
		UK TREASURY-0.375%-26/10/22	1,260,000.00	1,153,272.96
		UK TREASURY-4.125%-27/01/29	1,495,000.00	1,488,227.65
		UK TREASURY-3.75%-27/03/07	535,000.00	527,060.06
		UK TREASURY-1.25%-27/07/22	755,000.00	694,394.64
		UK TREASURY-4.25%-27/12/07	850,000.00	855,270.00
		UK TREASURY-0.125%-28/01/31	745,000.00	648,850.30
		UK TREASURY-4.5%-28/06/07	1,235,000.00	1,253,055.70
		UK TREASURY-1.625%-28/10/22	720,000.00	654,936.48
		UK TREASURY-6.0%-28/12/07	710,000.00	769,144.42
		UK TREASURY-0.5%-29/01/31	1,180,000.00	1,010,291.22
		UK TREASURY-4.125%-29/07/22	280,000.00	281,176.00
		UK TREASURY-0.875%-29/10/22	736,000.00	630,325.12
		UK TREASURY-0.375%-30/10/22	870,000.00	699,855.84
		UK TREASURY-4.75%-30/12/07	945,000.00	989,930.02
		UK TREASURY-0.25%-31/07/31	1,345,000.00	1,042,618.44

UK TREASURY-4.0%-31/10/22	75,000.00	75,124.95	
UK TREASURY-1.0%-32/01/31	1,645,000.00	1,329,250.47	
UK TREASURY-4.25%-32/06/07	1,030,000.00	1,053,329.50	
UK TREASURY-3.25%-33/01/31	1,540,000.00	1,457,657.74	
UK TREASURY-0.875%-33/07/31	1,340,000.00	1,021,607.96	
UK TREASURY-4.625%-34/01/31	760,000.00	794,544.26	
UK TREASURY-4.5%-34/09/07	789,000.00	816,753.07	
UK TREASURY-0.625%-35/07/31	967,000.00	668,912.58	
UK TREASURY-4.25%-36/03/07	970,000.00	979,603.00	
UK TREASURY-1.75%-37/09/07	1,280,000.00	963,683.84	
UK TREASURY-3.75%-38/01/29	650,000.00	615,747.60	
UK TREASURY-4.75%-38/12/07	935,000.00	981,002.00	
UK TREASURY-1.125%-39/01/31	747,000.00	491,239.89	
UK TREASURY-4.25%-39/09/07	850,000.00	841,585.00	
UK TREASURY-4.25%-40/12/07	815,000.00	802,515.83	
UK TREASURY-1.25%-41/10/22	1,360,000.00	846,032.88	
UK TREASURY-4.5%-42/12/07	1,040,000.00	1,047,904.00	
UK TREASURY-4.75%-43/10/22	260,000.00	269,168.90	
UK TREASURY-3.25%-44/01/22	1,115,000.00	937,944.69	
UK TREASURY-3.5%-45/01/22	1,160,000.00	1,005,836.00	
UK TREASURY-0.875%-46/01/31	435,000.00	219,735.46	
UK TREASURY-4.25%-46/12/07	720,000.00	694,129.68	
UK TREASURY-1.5%-47/07/22	1,005,000.00	575,171.55	
UK TREASURY-1.75%-49/01/22	675,000.00	401,113.35	
UK TREASURY-4.25%-49/12/07	895,000.00	859,161.51	
UK TREASURY-0.625%-50/10/22	770,000.00	316,123.50	
UK TREASURY-1.25%-51/07/31	600,000.00	297,660.00	
UK TREASURY-3.75%-52/07/22	872,000.00	767,065.26	
UK TREASURY-1.5%-53/07/31	580,000.00	300,057.20	
UK TREASURY-3.75%-53/10/22	970,000.00	848,816.93	
UK TREASURY-4.375%-54/07/31	170,000.00	165,631.00	
UK TREASURY-1.625%-54/10/22	925,000.00	490,211.15	
UK TREASURY-4.25%-55/12/07	962,000.00	920,922.60	
UK TREASURY-1.75%-57/07/22	1,075,000.00	578,651.00	
UK TREASURY-4.0%-60/01/22	751,000.00	689,675.59	
UK TREASURY-0.5%-61/10/22	1,050,000.00	322,633.50	
UK TREASURY-4.0%-63/10/22	370,000.00	338,414.58	
UK TREASURY-3.5%-68/07/22	830,000.00	688,214.42	
UNITED KINGDOM GILT-2.0%-25/09/07	765,000.00	741,327.07	
UNITED KINGDOM GILT-2.5%-65/07/22	742,000.00	477,144.58	
英債券小計	53,257,000.00	44,627,854.17	(8,919,769,212)

スウェーデン クローナ	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT-1.0%-26/11/12	3,930,000.00	3,800,129.22	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-28/05/12	3,550,000.00	3,359,059.70	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.75%-29/11/12	3,180,000.00	2,964,736.26	
		SWEDISH GOVERNMENT-0.125%-31/05/12	2,700,000.00	2,359,068.30	
		SWEDISH GOVERNMENT-2.25%-32/06/01	1,800,000.00	1,815,021.00	
		SWEDISH GOVERNMENT-1.75%-33/11/11	1,730,000.00	1,677,669.23	
		SWEDISH GOVERNMENT-3.5%-39/03/30	2,420,000.00	2,806,667.60	
スウェーデンクローナ小計			19,310,000.00	18,782,351.31	(281,171,799)
ノルウェー クローネ	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT-1.5%-26/02/19	2,400,000.00	2,309,318.40	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-27/02/17	2,400,000.00	2,289,760.80	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.0%-28/04/26	2,040,000.00	1,933,340.64	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.75%-29/09/06	1,930,000.00	1,776,561.14	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.375%-30/08/19	2,685,000.00	2,380,714.32	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-1.25%-31/09/17	2,040,000.00	1,756,619.52	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-2.125%-32/05/18	2,030,000.00	1,844,693.48	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.0%-33/08/15	2,350,000.00	2,263,649.25	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.625%-34/04/13	1,100,000.00	1,114,144.90	
		NORWEGIAN GOVERNMENT-3.5%-42/10/06	1,050,000.00	1,069,136.25	
ノルウェークローネ小計			20,025,000.00	18,737,938.70	(276,759,354)
デンマーク クローネ	国債証券	KINGDOM OF DENMARK-1.75%-25/11/15	3,125,000.00	3,078,218.75	
		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-27/11/15	2,630,000.00	2,464,517.77	
		KINGDOM OF DENMARK-0.5%-29/11/15	2,290,000.00	2,081,016.89	
		KINGDOM OF DENMARK-0.0%-31/11/15	1,350,000.00	1,139,576.85	
		KINGDOM OF DENMARK-2.25%-33/11/15	700,000.00	691,046.30	
		KINGDOM OF DENMARK-4.5%-39/11/15	7,205,000.00	8,943,436.81	
		KINGDOM OF DENMARK-0.25%-52/11/15	1,550,000.00	850,131.60	
デンマーククローネ小計			18,850,000.00	19,247,944.97	(435,003,556)
ポーランド ズロチ	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND-3.25%-25/07/25	2,270,000.00	2,231,693.75	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.0%-25/10/25	400,000.00	374,625.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-26/07/25	2,190,000.00	2,073,656.25	
		POLAND GOVERNMENT BOND-0.25%-26/10/25	1,600,000.00	1,427,500.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-3.75%-27/05/25	1,310,000.00	1,254,734.37	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	2,140,000.00	1,968,800.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-28/04/25	2,160,000.00	1,964,925.00	
		POLAND GOVERNMENT BOND-7.5%-28/07/25	1,720,000.00	1,844,162.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-5.75%-29/04/25	2,075,000.00	2,090,384.05	
		POLAND GOVERNMENT BOND-4.75%-29/07/25	500,000.00	480,781.25	
		POLAND GOVERNMENT BOND-2.75%-29/10/25	2,565,000.00	2,237,962.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-1.25%-30/10/25	2,025,000.00	1,563,679.68	

		POLAND GOVERNMENT BOND-1.75%-32/04/25	1,890,000.00	1,429,312.50	
		POLAND GOVERNMENT BOND-6.0%-33/10/25	2,145,000.00	2,187,229.68	
ポーランドズロチ小計			24,990,000.00	23,129,446.53	(890,934,715)
豪ドル	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.25%-25/11/21	950,000.00	900,131.65	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.25%-26/04/21	900,000.00	905,393.70	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-0.5%-26/09/21	1,210,000.00	1,123,105.06	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-27/04/21	980,000.00	1,004,569.58	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-27/11/21	830,000.00	801,975.05	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.25%-28/05/21	700,000.00	660,400.30	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-28/11/21	720,000.00	688,717.44	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-29/04/21	910,000.00	885,986.01	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-29/11/21	890,000.00	841,279.62	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.5%-30/05/21	1,020,000.00	944,801.52	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.0%-30/12/21	930,000.00	774,138.51	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.5%-31/06/21	1,083,000.00	920,198.02	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.0%-31/11/21	1,385,000.00	1,119,530.12	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.25%-32/05/21	1,350,000.00	1,096,205.40	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-32/11/21	1,195,000.00	998,018.59	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.5%-33/04/21	1,130,000.00	1,164,520.37	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-33/11/21	1,010,000.00	923,313.72	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-34/05/21	960,000.00	931,121.28	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.5%-34/12/21	855,000.00	808,645.32	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-35/06/21	700,000.00	613,467.40	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.75%-37/04/21	550,000.00	524,487.70	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.25%-39/06/21	582,000.00	513,920.55	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-2.75%-41/05/21	710,000.00	569,914.87	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT-3.0%-47/03/21	720,000.00	565,475.76	
AUSTRALIAN GOVERNMENT-1.75%-51/06/21	870,000.00	494,983.89			
AUSTRALIAN GOVERNMENT-4.75%-54/06/21	260,000.00	270,645.70			
豪ドル小計			23,400,000.00	21,044,947.13	(2,192,252,142)
ニュー ジーラン ドル	国債証券	NEW ZEALAND GOVERNMENT-0.5%-26/05/15	215,000.00	198,432.31	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-4.5%-27/04/15	700,000.00	698,285.70	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-0.25%-28/05/15	370,000.00	314,364.21	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-3.0%-29/04/20	680,000.00	637,067.52	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-4.5%-30/05/15	430,000.00	430,663.92	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-1.5%-31/05/15	350,000.00	288,262.45	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-2.0%-32/05/15	190,000.00	158,114.58	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-3.5%-33/04/14	430,000.00	396,939.88	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-4.25%-34/05/15	220,000.00	213,882.90	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-2.75%-37/04/15	430,000.00	347,731.54	

		NEW ZEALAND GOVERNMENT-1.75%-41/05/15	225,000.00	144,275.62	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-2.75%-51/05/15	500,000.00	340,283.00	
		NEW ZEALAND GOVERNMENT-5.0%-54/05/15	170,000.00	172,022.66	
ニュージーランドドル小計			4,910,000.00	4,340,326.29	(419,535,939)
シンガポールドル	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-72/08/01	240,000.00	235,920.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-25/06/01	480,000.00	474,624.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-0.5%-25/11/01	314,000.00	301,502.80	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.125%-26/06/01	420,000.00	410,004.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.25%-26/11/01	365,000.00	347,894.27	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.5%-27/03/01	498,000.00	501,187.20	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-27/09/01	150,000.00	148,410.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.625%-28/05/01	347,000.00	339,817.10	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-28/08/01	60,000.00	59,304.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.0%-29/04/01	33,000.00	32,755.30	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-29/07/01	365,000.00	359,963.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.875%-30/09/01	440,000.00	432,520.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.625%-31/07/01	300,000.00	270,960.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.625%-32/08/01	170,000.00	163,285.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-3.375%-33/09/01	335,000.00	340,360.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.25%-36/08/01	391,000.00	355,419.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.375%-39/07/01	220,000.00	198,778.80	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-42/04/01	280,000.00	265,580.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT-2.75%-46/03/01	387,000.00	362,787.34	
		SINGAPORE GOVERNMENT-1.875%-50/03/01	367,000.00	288,278.50	
SINGAPORE GOVERNMENT-1.875%-51/10/01	222,000.00	171,992.28			
シンガポールドル小計			6,384,000.00	6,061,342.59	(705,964,571)
マレーシアリンギット	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT-3.955%-25/09/15	1,050,000.00	1,058,242.50	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.906%-26/07/15	830,000.00	837,677.50	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.9%-26/11/30	920,000.00	929,706.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.899%-27/11/16	1,200,000.00	1,213,260.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.519%-28/04/20	350,000.00	348,775.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.504%-29/04/30	350,000.00	363,125.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.885%-29/08/15	1,320,000.00	1,334,520.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-2.632%-31/04/15	985,000.00	916,739.50	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.582%-32/07/15	100,000.00	98,150.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.642%-33/11/07	700,000.00	742,700.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-3.828%-34/07/05	1,000,000.00	996,500.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.254%-35/05/31	960,000.00	985,920.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.762%-37/04/07	1,320,000.00	1,419,660.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.893%-38/06/08	1,080,000.00	1,180,980.00	

		MALAYSIA GOVERNMENT-3.757%-40/05/22	1,490,000.00	1,434,870.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.696%-42/10/15	750,000.00	804,750.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.935%-43/09/30	660,000.00	727,164.24	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.736%-46/03/15	620,000.00	668,198.18	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.921%-48/07/06	510,000.00	563,805.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.065%-50/06/15	1,410,000.00	1,374,750.00	
		MALAYSIA GOVERNMENT-4.457%-53/03/31	580,000.00	602,388.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.392%-26/04/15	650,000.00	660,968.75	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.502%-27/05/31	950,000.00	949,097.50	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.733%-28/06/15	1,410,000.00	1,415,640.00	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.498%-30/04/15	1,150,000.00	1,195,629.70	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-4.232%-31/06/30	1,035,000.00	1,061,653.32	
		MALAYSIAN GOVERNMENT-3.844%-33/04/15	1,010,000.00	1,008,287.04	
		マレーシアリンギット小計	24,390,000.00	24,893,157.23	(830,249,026)
中国元	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND-2.18%-25/08/25	24,000,000.00	24,133,916.40	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.02%-25/10/22	32,000,000.00	32,582,336.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.28%-25/11/25	20,000,000.00	20,160,910.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.22%-25/12/06	18,800,000.00	19,235,050.80	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.46%-26/02/15	10,900,000.00	11,025,317.30	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.03%-26/03/11	17,000,000.00	17,385,959.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.3%-26/05/15	16,000,000.00	16,162,400.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.25%-26/06/06	11,000,000.00	11,340,736.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.69%-26/08/12	16,000,000.00	16,294,200.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.18%-26/08/15	12,000,000.00	12,084,085.80	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.39%-26/11/15	6,000,000.00	6,072,968.70	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.12%-26/12/05	23,000,000.00	23,740,508.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.37%-27/01/20	10,000,000.00	10,118,240.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.04%-27/02/25	14,000,000.00	14,054,336.10	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.85%-27/06/04	24,000,000.00	24,672,816.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.5%-27/07/25	5,000,000.00	5,081,260.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.44%-27/10/15	5,000,000.00	5,074,721.75	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.28%-27/12/03	19,500,000.00	20,459,643.75	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.64%-28/01/15	10,000,000.00	10,218,322.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.62%-28/04/15	11,000,000.00	11,239,860.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.01%-28/05/13	13,000,000.00	13,516,028.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.4%-28/07/15	9,900,000.00	10,033,702.96	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.48%-28/09/25	3,000,000.00	3,051,318.90	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.91%-28/10/14	22,000,000.00	22,807,565.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.55%-28/10/15	10,000,000.00	10,205,641.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.25%-28/11/22	10,000,000.00	10,561,990.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.37%-29/01/15	7,500,000.00	7,604,882.62	

		CHINA GOVERNMENT BOND-2.8%-29/03/24	15,000,000.00	15,496,207.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.29%-29/05/23	14,000,000.00	14,886,676.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.75%-29/06/15	3,000,000.00	3,095,046.30	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.62%-29/09/25	20,200,000.00	20,721,907.40	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.13%-29/11/21	2,700,000.00	2,850,437.25	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.79%-29/12/15	5,000,000.00	5,171,672.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.8%-30/03/25	15,000,000.00	15,536,250.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.68%-30/05/21	21,000,000.00	21,610,785.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.62%-30/06/25	9,800,000.00	10,048,477.04	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.6%-30/09/15	25,300,000.00	25,906,543.46	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.27%-30/11/19	11,000,000.00	11,790,966.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.54%-30/12/25	6,200,000.00	6,331,245.94	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.28%-31/03/25	13,000,000.00	13,066,912.95	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.02%-31/05/27	10,000,000.00	10,552,510.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.89%-31/11/18	9,000,000.00	9,416,534.85	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.75%-32/02/17	10,000,000.00	10,354,028.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.76%-32/05/15	9,000,000.00	9,323,085.15	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.69%-32/08/15	9,000,000.00	9,280,588.95	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.6%-32/09/01	7,400,000.00	7,582,277.17	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.8%-32/11/15	6,000,000.00	6,242,153.70	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.88%-33/02/25	11,000,000.00	11,527,449.45	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.67%-33/05/25	12,000,000.00	12,375,678.60	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.52%-33/08/25	12,800,000.00	13,035,683.84	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.67%-33/11/25	19,700,000.00	20,320,068.33	
		CHINA GOVERNMENT BOND-2.35%-34/02/25	10,000,000.00	10,053,825.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.81%-50/09/14	18,000,000.00	22,340,376.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.72%-51/04/12	9,000,000.00	11,036,623.50	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.53%-51/10/18	10,000,000.00	11,920,810.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.32%-52/04/15	10,000,000.00	11,554,950.00	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.12%-52/10/25	8,000,000.00	8,929,263.60	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.19%-53/04/15	9,000,000.00	10,225,826.10	
		CHINA GOVERNMENT BOND-3.0%-53/10/15	7,800,000.00	8,597,347.59	
	中国元小計		739,500,000.00	770,100,925.75 (16,711,652,149)	
イスラエル エルシュケ ル	国債証券	ISRAEL FIXED BOND-1.75%-25/08/31	1,190,000.00	1,154,206.84	
		ISRAEL FIXED BOND-0.5%-26/02/27	1,080,000.00	1,011,528.03	
		ISRAEL FIXED BOND-6.25%-26/10/30	950,000.00	987,768.15	
		ISRAEL FIXED BOND-2.0%-27/03/31	1,270,000.00	1,189,154.68	
		ISRAEL FIXED BOND-3.75%-27/09/30	320,000.00	312,194.58	
		ISRAEL FIXED BOND-2.25%-28/09/28	1,160,000.00	1,055,859.66	
		ISRAEL FIXED BOND-3.75%-29/02/28	750,000.00	721,795.65	
		ISRAEL FIXED BOND-1.0%-30/03/31	1,645,000.00	1,340,297.71	

	ISRAEL FIXED BOND-1.3%-32/04/30	1,360,000.00	1,049,042.20	
	ISRAEL FIXED BOND-4.0%-35/03/30	220,000.00	202,600.35	
	ISRAEL FIXED BOND-1.5%-37/05/31	1,150,000.00	765,659.48	
	ISRAEL FIXED BOND-5.5%-42/01/31	1,160,000.00	1,199,910.46	
	ISRAEL FIXED BOND-3.75%-47/03/31	1,300,000.00	1,028,641.57	
	ISRAEL FIXED BOND-2.8%-52/11/29	640,000.00	399,136.82	
イスラエルシュケル小計		14,195,000.00	12,417,796.18 (525,902,360)	
合計			168,779,266,015 (168,779,266,015)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額（単位：円）であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	国債証券 216銘柄	100.0%	47.3%
加ドル	国債証券 40銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 366銘柄	100.0%	30.8%
英ポンド	国債証券 61銘柄	100.0%	5.3%
スウェーデンクローナ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.2%
ノルウェークローネ	国債証券 10銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.3%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.5%
豪ドル	国債証券 26銘柄	100.0%	1.3%
ニュージーランドドル	国債証券 13銘柄	100.0%	0.2%
シンガポールドル	国債証券 21銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 27銘柄	100.0%	0.5%
中国元	国債証券 59銘柄	100.0%	9.9%
イスラエルシュケル	国債証券 14銘柄	100.0%	0.3%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2023年12月15日現在	2024年 6月17日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	311,319,484	299,696,528
株式	52,293,397,800	58,888,845,740
未収配当金	20,746,829	404,352,660
未収利息	-	676
前払金	2,201,500	2,920,000

	2023年12月15日現在	2024年 6月17日現在
流動資産合計	52,627,665,613	59,595,815,604
資産合計	52,627,665,613	59,595,815,604
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,554,250	13,541,000
未払金	186,364,060	165,983,820
未払解約金	22,925,777	11,544,635
未払利息	39	-
流動負債合計	210,844,126	191,069,455
負債合計	210,844,126	191,069,455
純資産の部		
元本等		
元本	21,959,599,100	21,236,631,163
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	30,457,222,387	38,168,114,986
元本等合計	52,416,821,487	59,404,746,149
純資産合計	52,416,821,487	59,404,746,149
負債純資産合計	52,627,665,613	59,595,815,604

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>（1）金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>（2）金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>（3）時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

	2023年12月15日現在	2024年 6月17日現在
1. 期首	2023年 6月16日	2023年12月16日
期首元本額	21,889,552,957円	21,959,599,100円
期首からの追加設定元本額	1,043,491,379円	976,898,370円
期首からの一部解約元本額	973,445,236円	1,699,866,307円
元本の内訳		
DCインデックスバランス（株式20）	739,007,576円	681,338,410円
DCインデックスバランス（株式40）	2,067,728,438円	1,947,507,760円
DCインデックスバランス（株式60）	4,433,581,108円	4,392,023,539円
DCインデックスバランス（株式80）	5,336,061,172円	5,655,513,527円
インデックスファンド日本株式（DC専用）	1,826,969,072円	1,844,251,733円
世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	2,642,431,737円	2,280,029,201円
インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	485,320,175円	421,039,181円
Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	1,119,147円	1,798,631円
Ni つみインデックスラップ世界10指数（均等型）	696,827円	992,874円
Ni つみインデックスラップ世界10指数（安定成長型）	311,821円	446,332円
国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	1,708,257,471円	1,438,069,127円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	202,958,766円	179,330,306円

		2023年12月15日現在	2024年 6月17日現在
年金積立	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	598,057,674円	546,561,944円
年金積立	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	954,286,999円	901,570,726円
年金積立	アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	962,811,117円	946,157,872円
	計	21,959,599,100円	21,236,631,163円
2.	受益権の総数	21,959,599,100口	21,236,631,163口
3.	担保資産 デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として担保に供している資産は次のとおりであります。 株式	715,615,500円	871,785,000円

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額
(金融商品に関する注記)
金融商品の状況に関する事項

	自 2023年 6月16日 至 2023年12月15日	自 2023年12月16日 至 2024年 6月17日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	2023年12月15日現在	2024年 6月17日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。 (3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(2023年12月15日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	2,391,691,564
合計	2,391,691,564

(2024年 6月17日現在)

売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	10,046,091,178
合計	10,046,091,178

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、親投資信託の期首日から本書における開示対象ファンドの計算期間末日までに対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(2023年12月15日現在)

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	117,951,500	-	116,400,000	1,551,500
	合計	117,951,500	-	116,400,000	1,551,500

(2024年 6月17日現在)

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	552,230,000	-	538,700,000	13,530,000
	合計	552,230,000	-	538,700,000	13,530,000

(注) 1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として本書における開示対象ファンドの計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、同計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2023年12月15日現在		2024年 6月17日現在	
1口当たり純資産額	2.3870円	1口当たり純資産額	2.7973円
(1万口当たり純資産額)	(23,870円)	(1万口当たり純資産額)	(27,973円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

（単位：円）

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	1,000	3,865.00	3,865,000	
ニッセイ	21,500	849.30	18,259,950	
マルハニチロ	3,200	3,102.00	9,926,400	
雪国まいたけ	2,200	982.00	2,160,400	

カネコ種苗	500	1,399.00	699,500
サカタのタネ	2,400	3,355.00	8,052,000
ホクト	1,700	1,863.00	3,167,100
ホクリヨウ	200	995.00	199,000
住石ホールディングス	3,200	1,321.00	4,227,200
日鉄鉱業	800	5,040.00	4,032,000
三井松島ホールディングス	1,400	4,685.00	6,559,000
I N P E X	72,800	2,268.00	165,110,400
石油資源開発	2,500	6,350.00	15,875,000
K & O エナジーグループ	900	4,170.00	3,753,000
ショーボンドホールディングス	3,000	5,748.00	17,244,000
ミライト・ワン	6,600	2,012.50	13,282,500
日本アクア	1,100	927.00	1,019,700
キャンディル	800	618.00	494,400
ダイセキ環境ソリューション	600	969.00	581,400
第一カッター興業	1,100	1,541.00	1,695,100
安藤・間	12,600	1,091.00	13,746,600
東急建設	6,800	752.00	5,113,600
コムシスホールディングス	6,900	3,087.00	21,300,300
ピーアールホールディングス	5,000	357.00	1,785,000
高松コンストラクショングループ	1,600	2,881.00	4,609,600
東建コーポレーション	500	12,130.00	6,065,000
ヤマウラ	1,600	1,275.00	2,040,000
オリエンタル白石	9,700	342.00	3,317,400
大成建設	13,900	5,754.00	79,980,600
大林組	54,300	1,773.00	96,273,900
清水建設	43,000	836.00	35,948,000
飛鳥建設	1,300	1,442.00	1,874,600
長谷工コーポレーション	14,000	1,710.50	23,947,000
松井建設	1,000	828.00	828,000
鹿島建設	33,600	2,669.00	89,678,400
不動テトラ	1,100	2,541.00	2,795,100
鉄建建設	1,200	2,515.00	3,018,000
西松建設	2,900	4,378.00	12,696,200
三井住友建設	10,600	392.00	4,155,200
大豊建設	400	3,375.00	1,350,000
奥村組	2,500	4,840.00	12,100,000
東鉄工業	2,000	3,110.00	6,220,000
イチケン	400	2,502.00	1,000,800
浅沼組	1,100	3,600.00	3,960,000
戸田建設	20,400	1,041.00	21,236,400
熊谷組	2,500	3,515.00	8,787,500

北野建設	200	3,580.00	716,000
植木組	300	1,614.00	484,200
矢作建設工業	2,500	1,545.00	3,862,500
ピーエス三菱	2,500	985.00	2,462,500
日本ハウスホールディングス	2,100	315.00	661,500
新日本建設	2,500	1,583.00	3,957,500
東亜道路工業	3,100	1,200.00	3,720,000
日本道路	1,700	1,729.00	2,939,300
東亜建設工業	5,100	1,018.00	5,191,800
日本国土開発	3,500	447.00	1,564,500
若築建設	700	3,475.00	2,432,500
東洋建設	4,100	1,382.00	5,666,200
五洋建設	21,800	629.30	13,718,740
福田組	600	5,530.00	3,318,000
住友林業	13,100	5,380.00	70,478,000
巴コーポレーション	1,100	806.00	886,600
大和ハウス工業	42,000	4,000.00	168,000,000
ライト工業	3,200	2,037.00	6,518,400
積水ハウス	46,000	3,423.00	157,458,000
日特建設	2,000	1,090.00	2,180,000
北陸電気工事	900	1,163.00	1,046,700
ユアテック	3,300	1,549.00	5,111,700
日本リーテック	1,000	1,186.00	1,186,000
四電工	600	3,540.00	2,124,000
中電工	2,200	3,090.00	6,798,000
関電工	9,400	1,675.00	15,745,000
きんでん	10,500	3,350.00	35,175,000
東京エネシス	1,200	1,334.00	1,600,800
トーエネック	400	5,900.00	2,360,000
住友電設	1,600	3,895.00	6,232,000
日本電設工業	2,800	1,884.00	5,275,200
エクシオグループ	14,800	1,569.00	23,221,200
新日本空調	1,100	4,055.00	4,460,500
九電工	3,300	5,780.00	19,074,000
三機工業	3,500	2,103.00	7,360,500
日揮ホールディングス	14,900	1,221.50	18,200,350
中外炉工業	600	3,215.00	1,929,000
ヤマト	300	963.00	288,900
太平電業	1,000	5,520.00	5,520,000
高砂熱学工業	4,100	6,150.00	25,215,000
三晃金属工業	200	4,335.00	867,000
朝日工業社	1,500	1,358.00	2,037,000

明星工業	3,000	1,250.00	3,750,000
大気社	1,800	5,090.00	9,162,000
ダイダン	2,100	3,190.00	6,699,000
日比谷総合設備	1,200	3,535.00	4,242,000
テスホールディングス	3,800	417.00	1,584,600
インフロニア・ホールディングス	17,600	1,243.00	21,876,800
東洋エンジニアリング	1,900	892.00	1,694,800
レイズネクスト	2,200	1,780.00	3,916,000
ニッポン	4,600	2,248.00	10,340,800
日清製粉グループ本社	14,100	1,791.00	25,253,100
日東富士製粉	400	7,570.00	3,028,000
昭和産業	1,600	3,095.00	4,952,000
中部飼料	2,000	1,528.00	3,056,000
フィード・ワン	2,600	936.00	2,433,600
東洋精糖	300	1,600.00	480,000
日本甜菜製糖	700	2,113.00	1,479,100
D M三井製糖ホールディングス	1,600	3,370.00	5,392,000
塩水港精糖	1,600	272.00	435,200
ウェルネオシュガー	900	2,339.00	2,105,100
森永製菓	6,500	2,498.00	16,237,000
中村屋	300	3,230.00	969,000
江崎グリコ	4,300	4,206.00	18,085,800
名糖産業	400	1,875.00	750,000
井村屋グループ	1,100	2,442.00	2,686,200
不二家	800	2,564.00	2,051,200
山崎製パン	10,200	3,440.00	35,088,000
モロゾフ	600	4,555.00	2,733,000
亀田製菓	800	4,105.00	3,284,000
寿スピリッツ	7,400	1,877.50	13,893,500
カルビー	7,000	3,075.00	21,525,000
森永乳業	5,400	3,248.00	17,539,200
六甲バター	800	1,485.00	1,188,000
ヤクルト本社	21,800	2,815.00	61,367,000
明治ホールディングス	18,700	3,472.00	64,926,400
雪印メグミルク	3,600	2,478.00	8,920,800
プリマハム	2,000	2,378.00	4,756,000
日本ハム	6,500	4,634.00	30,121,000
林兼産業	400	530.00	212,000
丸大食品	1,200	1,680.00	2,016,000
S Foods	1,700	2,853.00	4,850,100
柿安本店	400	2,545.00	1,018,000
伊藤ハム米久ホールディングス	2,300	4,160.00	9,568,000

サッポロホールディングス	5,000	5,615.00	28,075,000
アサヒグループホールディングス	35,200	5,630.00	198,176,000
キリンホールディングス	63,400	2,068.00	131,111,200
宝ホールディングス	10,300	1,063.00	10,948,900
オエノンホールディングス	6,000	367.00	2,202,000
養命酒製造	300	2,276.00	682,800
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	11,900	1,927.50	22,937,250
ライフドリンク カンパニー	400	6,680.00	2,672,000
サントリー食品インターナショナル	10,700	5,684.00	60,818,800
ダイドーグループホールディングス	1,700	2,675.00	4,547,500
伊藤園	5,200	3,419.00	17,778,800
キーコーヒー	1,600	2,054.00	3,286,400
ユニカフェ	400	918.00	367,200
ジャパンフーズ	300	1,992.00	597,600
日清オイリオグループ	2,100	4,765.00	10,006,500
不二製油グループ本社	3,500	2,832.50	9,913,750
J - オイルミルズ	1,700	1,937.00	3,292,900
キッコーマン	50,400	1,811.00	91,274,400
味の素	36,200	5,744.00	207,932,800
ブルドックソース	600	1,947.00	1,168,200
キューピー	8,200	3,156.00	25,879,200
ハウス食品グループ本社	5,300	2,887.00	15,301,100
カゴメ	6,500	3,340.00	21,710,000
アリアケジャパン	1,500	5,170.00	7,755,000
エバラ食品工業	400	2,898.00	1,159,200
やまみ	200	3,390.00	678,000
ニチレイ	7,000	3,616.00	25,312,000
東洋水産	7,700	9,638.00	74,212,600
イトアンドホールディングス	700	2,105.00	1,473,500
大冷	200	1,912.00	382,400
ヨシムラ・フード・ホールディングス	400	1,797.00	718,800
日清食品ホールディングス	16,100	4,183.00	67,346,300
永谷園ホールディングス	900	3,095.00	2,785,500
フジッコ	1,500	1,850.00	2,775,000
ロック・フィールド	1,800	1,416.00	2,548,800
日本たばこ産業	92,600	4,481.00	414,940,600
ケンコーマヨネーズ	1,000	1,947.00	1,947,000
わらべや日洋ホールディングス	900	2,282.00	2,053,800
なとり	1,100	2,121.00	2,333,100
イフジ産業	300	1,382.00	414,600
ファーマフーズ	2,600	975.00	2,535,000
ユーグレナ	9,200	544.00	5,004,800

紀文食品	1,000	1,258.00	1,258,000
ピクルスホールディングス	900	1,160.00	1,044,000
理研ビタミン	1,400	2,574.00	3,603,600
片倉工業	1,400	2,056.00	2,878,400
グンゼ	1,100	5,710.00	6,281,000
東洋紡	6,400	1,030.00	6,592,000
ユニチカ	4,300	275.00	1,182,500
富士紡ホールディングス	600	4,845.00	2,907,000
倉敷紡績	1,100	4,855.00	5,340,500
シキボウ	800	1,084.00	867,200
日本毛織	4,100	1,314.00	5,387,400
ダイドーリミテッド	2,500	728.00	1,820,000
帝国繊維	1,700	2,348.00	3,991,600
帝人	14,800	1,397.50	20,683,000
東レ	103,800	731.80	75,960,840
住江織物	100	2,490.00	249,000
セーレン	3,100	2,442.00	7,570,200
小松マテーレ	2,100	724.00	1,520,400
ワコールホールディングス	3,200	4,391.00	14,051,200
ホギメディカル	2,000	3,925.00	7,850,000
クラウディアホールディングス	1,800	426.00	766,800
T S Iホールディングス	4,400	920.00	4,048,000
マツオカコーポレーション	100	1,657.00	165,700
ワールド	2,300	2,004.00	4,609,200
三陽商会	600	2,432.00	1,459,200
オンワードホールディングス	9,500	609.00	5,785,500
ルックホールディングス	500	2,715.00	1,357,500
ゴールドウイン	2,800	8,545.00	23,926,000
デサント	2,700	3,345.00	9,031,500
特種東海製紙	900	3,595.00	3,235,500
王子ホールディングス	64,400	611.00	39,348,400
日本製紙	8,500	954.00	8,109,000
三菱製紙	500	807.00	403,500
北越コーポレーション	7,400	1,133.00	8,384,200
中越パルプ工業	600	1,529.00	917,400
大王製紙	6,400	866.40	5,544,960
レンゴー	14,300	999.50	14,292,850
トモク	900	2,707.00	2,436,300
ザ・パック	1,200	3,560.00	4,272,000
北の達人コーポレーション	7,900	182.00	1,437,800
クラレ	22,500	1,816.00	40,860,000
旭化成	104,800	998.50	104,642,800

レゾナック・ホールディングス	14,900	3,450.00	51,405,000	
住友化学	114,700	308.90	35,430,830	
住友精化	700	5,100.00	3,570,000	
日産化学	7,300	4,597.00	33,558,100	
ラサ工業	500	2,993.00	1,496,500	
クレハ	3,300	2,731.00	9,012,300	
多木化学	500	4,150.00	2,075,000	
テイカ	1,100	1,661.00	1,827,100	
石原産業	2,400	1,530.00	3,672,000	
日本曹達	1,800	5,010.00	9,018,000	
東ソー	20,600	2,034.50	41,910,700	
トクヤマ	5,000	2,920.50	14,602,500	
セントラル硝子	1,900	3,525.00	6,697,500	
東亜合成	7,500	1,479.50	11,096,250	
大阪ソーダ	1,100	10,670.00	11,737,000	
関東電化工業	2,600	929.00	2,415,400	
デンカ	5,600	2,087.00	11,687,200	
信越化学工業	139,000	5,943.00	826,077,000	代用有価証券 24,000株
日本カーバイド工業	600	1,928.00	1,156,800	
堺化学工業	1,100	2,731.00	3,004,100	
第一稀元素化学工業	1,400	799.00	1,118,600	
エア・ウォーター	14,600	2,144.50	31,309,700	
日本酸素ホールディングス	15,000	4,543.00	68,145,000	
日本化学工業	500	2,519.00	1,259,500	
東邦アセチレン	1,200	362.00	434,400	
日本パーカラライジング	6,900	1,223.00	8,438,700	
高压ガス工業	2,400	940.00	2,256,000	
四国化成ホールディングス	1,900	2,041.00	3,877,900	
戸田工業	700	2,033.00	1,423,100	
ステラ ケミファ	800	4,185.00	3,348,000	
保土谷化学工業	400	5,530.00	2,212,000	
日本触媒	9,000	1,537.50	13,837,500	
大日精化工業	1,000	3,185.00	3,185,000	
カネカ	3,800	4,183.00	15,895,400	
三菱瓦斯化学	11,300	3,039.00	34,340,700	
三井化学	12,800	4,337.00	55,513,600	
東京応化工業	7,400	4,475.00	33,115,000	
大阪有機化学工業	1,200	3,545.00	4,254,000	
三菱ケミカルグループ	113,200	804.80	91,103,360	
KHネオケム	2,600	2,215.00	5,759,000	
ダイセル	20,200	1,539.50	31,097,900	
住友ベークライト	4,300	4,696.00	20,192,800	

積水化学工業	31,100	2,211.00	68,762,100
日本ゼオン	10,600	1,383.50	14,665,100
アイカ工業	3,900	3,459.00	13,490,100
U B E	7,300	2,684.50	19,596,850
積水樹脂	2,300	2,320.00	5,336,000
タキロンシーアイ	3,400	679.00	2,308,600
旭有機材	1,100	4,815.00	5,296,500
ニチバン	1,000	1,880.00	1,880,000
リケンテクノス	3,100	979.00	3,034,900
大倉工業	800	2,786.00	2,228,800
積水化成成品工業	1,500	451.00	676,500
群栄化学工業	300	3,175.00	952,500
タイガースポリマー	500	831.00	415,500
ダイキョーニシカワ	3,600	670.00	2,412,000
森六ホールディングス	700	2,731.00	1,911,700
恵和	1,400	1,668.00	2,335,200
日本化薬	11,800	1,206.50	14,236,700
カーリットホールディングス	1,400	1,310.00	1,834,000
日本精化	1,100	2,534.00	2,787,400
扶桑化学工業	1,700	3,800.00	6,460,000
トリケミカル研究所	1,800	3,905.00	7,029,000
A D E K A	5,300	3,179.00	16,848,700
日油	14,100	2,040.00	28,764,000
ハリマ化成グループ	700	887.00	620,900
花王	35,000	6,756.00	236,460,000
第一工業製薬	500	3,690.00	1,845,000
石原ケミカル	600	2,035.00	1,221,000
三洋化成工業	900	3,905.00	3,514,500
大日本塗料	1,900	1,266.00	2,405,400
日本ペイントホールディングス	82,200	1,043.00	85,734,600
関西ペイント	13,600	2,563.00	34,856,800
中国塗料	3,400	1,989.00	6,762,600
日本特殊塗料	300	1,211.00	363,300
藤倉化成	1,300	574.00	746,200
太陽ホールディングス	2,700	3,210.00	8,667,000
D I C	6,000	3,162.00	18,972,000
サカタインクス	3,100	1,828.00	5,666,800
a r t i e n c e	3,400	3,360.00	11,424,000
富士フイルムホールディングス	86,300	3,640.00	314,132,000
資生堂	32,400	5,003.00	162,097,200
ライオン	19,700	1,277.50	25,166,750
高砂香料工業	1,100	3,665.00	4,031,500

マンダム	3,100	1,209.00	3,747,900
ミルボン	2,300	3,384.00	7,783,200
ファンケル	7,000	2,774.50	19,421,500
コーセー	3,100	11,115.00	34,456,500
コタ	2,100	1,469.00	3,084,900
ポーラ・オルビスホールディングス	8,000	1,355.00	10,840,000
ノエビアホールディングス	1,500	5,400.00	8,100,000
新日本製薬	1,400	1,670.00	2,338,000
I - n e	1,000	1,733.00	1,733,000
アクシージア	2,100	1,013.00	2,127,300
エステー	1,600	1,543.00	2,468,800
アグロ カネショウ	500	1,188.00	594,000
コニシ	4,500	1,212.00	5,454,000
長谷川香料	2,900	3,085.00	8,946,500
小林製薬	4,600	5,609.00	25,801,400
荒川化学工業	1,100	1,130.00	1,243,000
メック	1,300	4,425.00	5,752,500
日本高純度化学	300	3,155.00	946,500
タカラバイオ	3,900	1,016.00	3,962,400
J C U	1,900	3,710.00	7,049,000
O A T アグリオ	1,000	1,585.00	1,585,000
デクセリアルズ	3,900	7,332.00	28,594,800
アース製薬	1,500	4,765.00	7,147,500
北興化学工業	1,700	1,498.00	2,546,600
大成ラミック	400	2,812.00	1,124,800
クミアイ化学工業	6,700	776.00	5,199,200
日本農薬	2,400	778.00	1,867,200
アキレス	700	1,591.00	1,113,700
有沢製作所	2,500	1,555.00	3,887,500
日東電工	10,000	12,265.00	122,650,000
レック	1,700	1,473.00	2,504,100
三光合成	1,600	674.00	1,078,400
藤森工業	1,200	4,200.00	5,040,000
前澤化成工業	900	1,800.00	1,620,000
未来工業	600	4,230.00	2,538,000
J S P	1,100	2,209.00	2,429,900
エフピコ	3,100	2,302.00	7,136,200
天馬	1,100	2,683.00	2,951,300
信越ポリマー	3,200	1,429.00	4,572,800
東リ	2,100	389.00	816,900
ニフコ	4,600	3,697.00	17,006,200
バルカー	1,400	3,565.00	4,991,000

ユニ・チャーム	32,300	5,232.00	168,993,600
協和キリン	18,700	2,717.50	50,817,250
武田薬品工業	137,300	4,167.00	572,129,100
アステラス製薬	136,100	1,509.50	205,442,950
住友ファーマ	10,600	349.00	3,699,400
塩野義製薬	18,900	6,147.00	116,178,300
日本新薬	4,100	3,212.00	13,169,200
中外製薬	48,600	4,942.00	240,181,200
科研製薬	2,600	3,756.00	9,765,600
エーザイ	18,900	6,375.00	120,487,500
ロート製薬	15,000	3,132.00	46,980,000
小野薬品工業	31,700	2,142.50	67,917,250
久光製薬	3,500	3,728.00	13,048,000
持田製薬	1,700	2,972.00	5,052,400
参天製薬	27,300	1,587.00	43,325,100
扶桑薬品工業	400	2,277.00	910,800
ツムラ	4,900	4,063.00	19,908,700
キッセイ薬品工業	2,500	3,145.00	7,862,500
生化学工業	2,000	841.00	1,682,000
栄研化学	2,700	2,084.00	5,626,800
鳥居薬品	800	3,580.00	2,864,000
JCRファーマ	5,100	587.00	2,993,700
東和薬品	2,500	3,025.00	7,562,500
富士製薬工業	1,500	1,463.00	2,194,500
ゼリア新薬工業	2,300	2,058.00	4,733,400
ネクセラファーマ	6,800	1,532.00	10,417,600
第一三共	135,200	5,400.00	730,080,000
杏林製薬	3,300	1,695.00	5,593,500
大幸薬品	2,100	398.00	835,800
ダイト	1,200	2,241.00	2,689,200
大塚ホールディングス	32,300	6,257.00	202,101,100
ペプチドリーム	7,500	2,257.00	16,927,500
セルソース	1,000	1,345.00	1,345,000
あすか製薬ホールディングス	1,800	2,399.00	4,318,200
サワイグループホールディングス	3,600	5,650.00	20,340,000
日本コークス工業	12,000	126.00	1,512,000
ニチレキ	2,000	2,427.00	4,854,000
ユシロ化学工業	600	1,834.00	1,100,400
ビーピー・カストロール	600	978.00	586,800
富士石油	5,600	541.00	3,029,600
MORESCO	300	1,341.00	402,300
出光興産	80,500	1,059.00	85,249,500

E N E O Sホールディングス	245,600	807.00	198,199,200
コスモエネルギーホールディングス	4,600	7,779.00	35,783,400
横浜ゴム	7,800	3,544.00	27,643,200
TOYO TIRE	9,000	2,564.50	23,080,500
ブリヂストン	45,400	6,448.00	292,739,200
住友ゴム工業	15,200	1,618.50	24,601,200
藤倉コンポジット	1,400	1,388.00	1,943,200
オカモト	800	4,845.00	3,876,000
フコク	600	2,430.00	1,458,000
ニッタ	1,600	3,845.00	6,152,000
住友理工	2,500	1,328.00	3,320,000
三ツ星ベルト	1,800	4,360.00	7,848,000
バンドー化学	2,200	1,835.00	4,037,000
日東紡績	1,900	6,530.00	12,407,000
A G C	13,800	5,204.00	71,815,200
日本板硝子	8,600	418.00	3,594,800
石塚硝子	300	2,856.00	856,800
日本山村硝子	700	1,668.00	1,167,600
日本電気硝子	6,200	3,636.00	22,543,200
オハラ	400	1,305.00	522,000
住友大阪セメント	2,500	3,988.00	9,970,000
太平洋セメント	9,100	3,988.00	36,290,800
日本ヒューム	1,000	1,265.00	1,265,000
日本コンクリート工業	2,000	361.00	722,000
三谷セキサン	700	5,870.00	4,109,000
アジアパイルホールディングス	2,400	1,002.00	2,404,800
東海カーボン	14,100	918.00	12,943,800
日本カーボン	800	5,370.00	4,296,000
東洋炭素	1,000	6,960.00	6,960,000
ノリタケカンパニーリミテド	1,700	3,860.00	6,562,000
T O T O	10,200	3,678.00	37,515,600
日本碍子	17,900	1,993.50	35,683,650
日本特殊陶業	12,900	4,610.00	59,469,000
M A R U W A	600	37,800.00	22,680,000
品川リフラクトリーズ	2,300	1,988.00	4,572,400
黒崎播磨	1,400	2,827.00	3,957,800
ヨータイ	1,400	1,800.00	2,520,000
フジインコーポレーテッド	4,100	2,858.00	11,717,800
エーアンドエーマテリアル	500	1,320.00	660,000
ニチアス	4,000	4,720.00	18,880,000
ニチハ	1,900	3,375.00	6,412,500
日本製鉄	71,600	3,304.00	236,566,400

神戸製鋼所	32,100	1,946.50	62,482,650
合同製鐵	1,000	5,200.00	5,200,000
J F E ホールディングス	44,400	2,256.00	100,166,400
東京製鐵	4,800	1,661.00	7,972,800
共英製鋼	1,800	2,047.00	3,684,600
大和工業	3,000	7,609.00	22,827,000
東京鐵鋼	900	5,260.00	4,734,000
大阪製鐵	600	2,361.00	1,416,600
淀川製鋼所	1,800	5,420.00	9,756,000
中部鋼板	1,300	2,945.00	3,828,500
丸一鋼管	4,900	3,717.00	18,213,300
モリ工業	400	5,040.00	2,016,000
大同特殊鋼	10,100	1,461.50	14,761,150
日本高周波鋼業	1,500	453.00	679,500
日本冶金工業	1,300	4,540.00	5,902,000
山陽特殊製鋼	1,600	2,081.00	3,329,600
愛知製鋼	900	3,615.00	3,253,500
大平洋金属	1,100	1,257.00	1,382,700
新日本電工	7,000	282.00	1,974,000
栗本鐵工所	800	4,655.00	3,724,000
三菱製鋼	1,000	1,483.00	1,483,000
日本精線	1,500	1,196.00	1,794,000
エンビプロ・ホールディングス	1,300	530.00	689,000
新家工業	200	5,270.00	1,054,000
大紀アルミニウム工業所	1,800	1,252.00	2,253,600
日本軽金属ホールディングス	4,500	1,791.00	8,059,500
三井金属鉱業	4,600	4,783.00	22,001,800
三菱マテリアル	11,300	2,853.00	32,238,900
住友金属鉱山	18,500	4,688.00	86,728,000
D O W A ホールディングス	3,900	5,398.00	21,052,200
古河機械金属	2,500	1,826.00	4,565,000
エス・サイエンス	35,100	23.00	807,300
大阪チタニウムテクノロジーズ	3,100	2,804.00	8,692,400
東邦チタニウム	3,000	1,323.00	3,969,000
U A C J	2,100	3,925.00	8,242,500
C K サンエツ	500	3,655.00	1,827,500
古河電気工業	5,200	4,183.00	21,751,600
住友電気工業	59,700	2,549.00	152,175,300
フジクラ	18,800	3,273.00	61,532,400
S W C C	1,900	4,775.00	9,072,500
タツタ電線	3,200	769.00	2,460,800
カナレ電気	200	1,544.00	308,800

平河ヒューテック	1,000	1,451.00	1,451,000
リョービ	1,600	2,295.00	3,672,000
アーレスティ	400	690.00	276,000
A R E ホールディングス	6,100	1,997.00	12,181,700
稲葉製作所	1,000	1,944.00	1,944,000
宮地エンジニアリンググループ	1,000	4,705.00	4,705,000
トーカロ	4,900	1,909.00	9,354,100
S U M C O	28,300	2,346.50	66,405,950
川田テクノロジーズ	1,200	2,645.00	3,174,000
R S T e c h n o l o g i e s	1,300	3,530.00	4,589,000
信和	100	741.00	74,100
東洋製罐グループホールディングス	9,000	2,477.50	22,297,500
ホッカカンホールディングス	700	1,716.00	1,201,200
コロナ	800	929.00	743,200
横河ブリッジホールディングス	2,700	2,609.00	7,044,300
三和ホールディングス	16,100	2,851.00	45,901,100
文化シャッター	4,500	1,670.00	7,515,000
三協立山	1,600	787.00	1,259,200
アルインコ	1,500	1,070.00	1,605,000
東洋シャッター	900	943.00	848,700
L I X I L	24,800	1,658.50	41,130,800
ノーリツ	2,300	1,786.00	4,107,800
長府製作所	1,400	2,150.00	3,010,000
リンナイ	7,600	3,725.00	28,310,000
日東精工	2,100	574.00	1,205,400
三洋工業	300	3,255.00	976,500
岡部	2,400	755.00	1,812,000
ジーテクト	1,900	1,873.00	3,558,700
東プレ	2,700	2,165.00	5,845,500
高周波熱錬	2,000	1,090.00	2,180,000
東京製綱	1,300	1,292.00	1,679,600
サンコール	1,200	450.00	540,000
パイオラックス	1,800	2,225.00	4,005,000
エイチワン	1,200	920.00	1,104,000
日本発條	13,900	1,540.50	21,412,950
中央発條	900	1,328.00	1,195,200
立川ブラインド工業	600	1,324.00	794,400
三益半導体工業	1,500	3,675.00	5,512,500
日本ドライケミカル	400	2,577.00	1,030,800
日本製鋼所	4,300	4,297.00	18,477,100
三浦工業	6,600	3,167.00	20,902,200
タクマ	5,300	1,615.00	8,559,500

ツガミ	3,500	1,542.00	5,397,000
オークマ	1,400	6,624.00	9,273,600
芝浦機械	1,700	3,610.00	6,137,000
アマダ	23,600	1,704.50	40,226,200
アイダエンジニアリング	3,300	859.00	2,834,700
F U J I	7,300	2,460.00	17,958,000
牧野フライス製作所	1,700	6,450.00	10,965,000
オーエスジー	6,900	1,881.50	12,982,350
旭ダイヤモンド工業	3,300	903.00	2,979,900
D M G 森精機	10,700	4,157.00	44,479,900
ソディック	3,100	710.00	2,201,000
ディスコ	7,500	63,880.00	479,100,000
日東工器	600	2,325.00	1,395,000
日進工具	1,800	958.00	1,724,400
富士ダイス	800	787.00	629,600
リケンNPR	1,500	2,666.00	3,999,000
島精機製作所	2,200	1,671.00	3,676,200
オプトラン	2,500	2,028.00	5,070,000
イワキポンプ	1,300	2,498.00	3,247,400
フリー	2,000	1,075.00	2,150,000
ヤマシンフィルタ	2,800	363.00	1,016,400
日阪製作所	1,300	1,023.00	1,329,900
やまびこ	2,800	2,170.00	6,076,000
野村マイクロ・サイエンス	2,200	4,385.00	9,647,000
平田機工	700	6,570.00	4,599,000
P E G A S U S	1,300	554.00	720,200
マルマエ	500	2,103.00	1,051,500
タツモ	1,000	3,560.00	3,560,000
ナブテスコ	9,800	2,693.00	26,391,400
三井海洋開発	2,000	2,642.00	5,284,000
レオン自動機	2,200	1,552.00	3,414,400
S M C	4,700	76,500.00	359,550,000
ホソカワミクロン	1,100	3,970.00	4,367,000
ユニオンツール	600	5,980.00	3,588,000
瑞光	900	1,055.00	949,500
オイレス工業	2,100	2,290.00	4,809,000
日精エー・エス・ビー機械	600	5,320.00	3,192,000
サトーホールディングス	2,100	2,066.00	4,338,600
技研製作所	1,300	1,916.00	2,490,800
日本エアーテック	600	1,181.00	708,600
日精樹脂工業	900	1,011.00	909,900
オカダアイオン	400	2,385.00	954,000

ワイエイシイホールディングス	500	2,461.00	1,230,500
小松製作所	73,200	4,379.00	320,542,800
住友重機械工業	9,200	4,109.00	37,802,800
日立建機	6,200	3,995.00	24,769,000
日工	1,900	738.00	1,402,200
巴工業	600	4,615.00	2,769,000
井関農機	1,100	1,032.00	1,135,200
TOWA	1,700	11,220.00	19,074,000
北川鉄工所	400	1,415.00	566,000
ローツェ	800	30,650.00	24,520,000
タカキタ	900	458.00	412,200
クボタ	81,600	2,202.50	179,724,000
荏原実業	1,000	3,645.00	3,645,000
三菱化工機	700	4,165.00	2,915,500
月島ホールディングス	1,900	1,382.00	2,625,800
帝国電機製作所	1,300	2,406.00	3,127,800
新東工業	2,900	1,043.00	3,024,700
澁谷工業	1,400	3,820.00	5,348,000
アイチ コーポレーション	2,200	1,178.00	2,591,600
小森コーポレーション	3,700	1,288.00	4,765,600
鶴見製作所	1,200	4,135.00	4,962,000
酒井重工業	300	5,800.00	1,740,000
荏原製作所	6,400	11,910.00	76,224,000
石井鐵工所	200	2,821.00	564,200
西島製作所	1,400	3,375.00	4,725,000
北越工業	1,700	2,450.00	4,165,000
ダイキン工業	18,700	22,960.00	429,352,000
オルガノ	1,900	8,390.00	15,941,000
トーヨーカネツ	500	3,810.00	1,905,000
栗田工業	8,700	6,700.00	58,290,000
椿本チエイン	2,100	6,070.00	12,747,000
木村化工機	1,600	703.00	1,124,800
アネスト岩田	2,900	1,476.00	4,280,400
ダイフク	26,300	2,900.00	76,270,000
サムコ	400	3,785.00	1,514,000
加藤製作所	100	1,260.00	126,000
タダノ	8,700	1,087.00	9,456,900
フジテック	3,800	4,167.00	15,834,600
C K D	4,300	3,230.00	13,889,000
平和	4,600	2,026.00	9,319,600
理想科学工業	1,300	3,190.00	4,147,000
SANKYO	15,300	1,668.00	25,520,400

日本金銭機械	2,300	1,328.00	3,054,400	
マースグループホールディングス	1,000	3,740.00	3,740,000	
フクシマガリレイ	1,100	6,390.00	7,029,000	
オーイズミ	200	357.00	71,400	
ダイコク電機	1,000	4,005.00	4,005,000	
竹内製作所	2,900	5,620.00	16,298,000	
アマノ	4,500	3,990.00	17,955,000	
J U K I	1,900	501.00	951,900	
ジャノメ	1,100	674.00	741,400	
マックス	2,200	3,850.00	8,470,000	
グローリー	3,700	2,711.50	10,032,550	
新晃工業	1,700	3,775.00	6,417,500	
大和冷機工業	2,400	1,487.00	3,568,800	
セガサミーホールディングス	14,100	2,390.00	33,699,000	
T P R	1,900	2,442.00	4,639,800	
ツバキ・ナカシマ	2,500	758.00	1,895,000	
ホシザキ	9,200	5,064.00	46,588,800	
大豊工業	1,000	770.00	770,000	
日本精工	28,600	749.20	21,427,120	
N T N	33,700	294.30	9,917,910	
ジェイテクト	13,900	1,055.00	14,664,500	
不二越	1,000	3,425.00	3,425,000	
日本トムソン	3,700	595.00	2,201,500	
T H K	9,000	2,845.00	25,605,000	
ユーシン精機	1,000	714.00	714,000	
前澤給装工業	1,000	1,323.00	1,323,000	
イーグル工業	1,600	1,879.00	3,006,400	
前澤工業	600	1,435.00	861,000	
日本ピラー工業	1,500	5,270.00	7,905,000	
キッツ	5,600	1,115.00	6,244,000	
マキタ	17,800	4,413.00	78,551,400	
三井E & S	8,100	1,373.00	11,121,300	
日立造船	14,000	1,028.00	14,392,000	
三菱重工業	273,200	1,488.00	406,521,600	
I H I	11,600	3,758.00	43,592,800	
スター精密	3,100	2,126.00	6,590,600	
日清紡ホールディングス	11,800	1,092.00	12,885,600	
イビデン	8,200	6,630.00	54,366,000	
コニカミノルタ	34,700	443.30	15,382,510	
ブラザー工業	20,900	2,777.50	58,049,750	
ミネベアミツミ	27,200	3,179.00	86,468,800	
日立製作所	75,100	16,725.00	1,256,047,500	代用有価証券 12,000株

三菱電機	173,900	2,530.00	439,967,000
富士電機	9,500	8,957.00	85,091,500
安川電機	17,000	5,850.00	99,450,000
シンフォニアテクノロジー	1,800	3,405.00	6,129,000
明電舎	2,900	4,065.00	11,788,500
山洋電気	700	6,780.00	4,746,000
デンヨー	1,200	2,721.00	3,265,200
PHCホールディングス	2,800	1,143.00	3,200,400
KOKUSAI ELECTRIC	8,200	5,000.00	41,000,000
ソシオネクスト	11,400	4,030.00	45,942,000
東芝テック	1,900	3,170.00	6,023,000
芝浦メカトロニクス	1,000	7,820.00	7,820,000
マブチモーター	7,700	2,410.50	18,560,850
ニデック	34,500	7,255.00	250,297,500
トレックス・セミコンダクター	600	1,850.00	1,110,000
東光高岳	800	1,996.00	1,596,800
ダブル・スコープ	3,600	534.00	1,922,400
ダイヘン	1,500	8,150.00	12,225,000
ヤーマン	3,200	909.00	2,908,800
JVCケンウッド	12,400	888.00	11,011,200
ミマキエンジニアリング	2,000	2,138.00	4,276,000
I-PEX	800	1,972.00	1,577,600
大崎電気工業	2,900	654.00	1,896,600
オムロン	11,900	5,126.00	60,999,400
日東工業	2,100	3,340.00	7,014,000
IDEC	2,300	2,892.00	6,651,600
正興電機製作所	300	1,558.00	467,400
ジーエス・ユアサコーポレーション	6,100	3,231.00	19,709,100
サクサホールディングス	200	2,604.00	520,800
メルコホールディングス	500	3,485.00	1,742,500
テクノメディカ	800	1,782.00	1,425,600
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	500	695.00	347,500
日本電気	20,500	12,345.00	253,072,500
富士通	143,800	2,376.50	341,740,700
沖電気工業	7,100	984.00	6,986,400
電気興業	500	2,075.00	1,037,500
サンケン電気	1,400	6,529.00	9,140,600
アイホン	900	2,991.00	2,691,900
ルネサスエレクトロニクス	97,400	3,143.00	306,128,200
セイコーエプソン	20,100	2,401.00	48,260,100
ワコム	11,200	711.00	7,963,200
アルバック	3,400	10,555.00	35,887,000

アクセル	1,100	1,542.00	1,696,200
E I Z O	1,100	4,715.00	5,186,500
日本信号	3,500	994.00	3,479,000
京三製作所	2,700	662.00	1,787,400
能美防災	2,100	2,243.00	4,710,300
ホーチキ	1,400	2,223.00	3,112,200
星和電機	200	555.00	111,000
エレコム	4,000	1,562.00	6,248,000
パナソニック ホールディングス	184,600	1,259.00	232,411,400
シャープ	26,400	983.10	25,953,840
アンリツ	11,100	1,143.50	12,692,850
富士通ゼネラル	4,300	2,098.50	9,023,550
ソニーグループ	108,400	12,695.00	1,376,138,000
T D K	24,700	8,863.00	218,916,100
帝国通信工業	600	1,965.00	1,179,000
タムラ製作所	5,900	714.00	4,212,600
アルプスアルパイン	13,900	1,527.50	21,232,250
日本電波工業	2,000	1,108.00	2,216,000
鈴木	600	1,497.00	898,200
メイコー	1,600	7,440.00	11,904,000
日本トリム	600	3,380.00	2,028,000
ローランド ディー . ジー .	400	5,340.00	2,136,000
フォスター電機	1,000	1,784.00	1,784,000
S M K	300	2,385.00	715,500
ヨコオ	1,100	2,106.00	2,316,600
ホシデン	3,500	2,025.00	7,087,500
ヒロセ電機	2,300	17,910.00	41,193,000
日本航空電子工業	3,700	2,475.00	9,157,500
T O A	1,500	1,080.00	1,620,000
マクセル	3,100	1,859.00	5,762,900
古野電気	2,300	1,999.00	4,597,700
スミダコーポレーション	2,100	1,161.00	2,438,100
アイコム	600	3,015.00	1,809,000
リオン	700	2,799.00	1,959,300
横河電機	17,100	3,780.00	64,638,000
新電元工業	500	2,970.00	1,485,000
アズビル	10,600	4,127.00	43,746,200
東亜ディーケーケー	500	852.00	426,000
日本光電工業	6,700	4,678.00	31,342,600
チノー	900	2,460.00	2,214,000
日本電子材料	900	3,545.00	3,190,500
堀場製作所	3,000	11,750.00	35,250,000

アドバンテスト	44,300	5,337.00	236,429,100
エスベック	1,300	3,135.00	4,075,500
キーエンス	15,500	67,790.00	1,050,745,000
日置電機	800	6,750.00	5,400,000
シスメックス	40,100	2,529.00	101,412,900
日本マイクロニクス	2,800	5,890.00	16,492,000
メガチップス	1,200	4,235.00	5,082,000
O B A R A G R O U P	1,000	4,200.00	4,200,000
原田工業	1,100	576.00	633,600
コーセル	2,000	1,332.00	2,664,000
イリソ電子工業	1,400	2,944.00	4,121,600
オブテックスグループ	3,100	1,558.00	4,829,800
千代田インテグレ	700	3,230.00	2,261,000
レーザーテック	7,100	36,170.00	256,807,000
スタンレー電気	9,900	2,789.50	27,616,050
ウシオ電機	6,900	2,042.50	14,093,250
岡谷電機産業	400	245.00	98,000
日本セラミック	1,300	2,532.00	3,291,600
遠藤照明	700	1,502.00	1,051,400
古河電池	1,300	1,316.00	1,710,800
山一電機	1,400	3,465.00	4,851,000
図研	1,300	3,855.00	5,011,500
日本電子	3,900	6,507.00	25,377,300
カシオ計算機	11,300	1,171.00	13,232,300
ファナック	75,500	4,265.00	322,007,500
日本シイエムケイ	2,900	604.00	1,751,600
エンプラス	400	8,020.00	3,208,000
大真空	1,800	692.00	1,245,600
ローム	28,600	2,123.50	60,732,100
浜松ホトニクス	12,400	4,444.00	55,105,600
三井ハイテック	1,400	6,278.00	8,789,200
新光電気工業	5,500	5,689.00	31,289,500
京セラ	96,100	1,811.50	174,085,150
太陽誘電	7,500	4,057.00	30,427,500
村田製作所	140,800	3,238.00	455,910,400
双葉電子工業	2,300	600.00	1,380,000
ニチコン	4,000	1,156.00	4,624,000
日本ケミコン	1,300	1,579.00	2,052,700
K O A	2,300	1,464.00	3,367,200
市光工業	4,200	541.00	2,272,200
小糸製作所	16,000	2,146.50	34,344,000
ミツバ	3,300	1,086.00	3,583,800

SCREENホールディングス	5,300	14,725.00	78,042,500	
キャノン電子	1,600	2,279.00	3,646,400	
キャノン	77,200	4,359.00	336,514,800	
リコー	38,800	1,358.00	52,690,400	
象印マホービン	3,900	1,466.00	5,717,400	
東京エレクトロン	32,700	34,080.00	1,114,416,000	
イノテック	900	1,711.00	1,539,900	
トヨタ紡織	6,600	2,073.00	13,681,800	
芦森工業	200	2,426.00	485,200	
ユニプレス	2,600	1,354.00	3,520,400	
豊田自動織機	13,200	12,940.00	170,808,000	
モリタホールディングス	2,700	1,843.00	4,976,100	
三櫻工業	2,100	980.00	2,058,000	
デンソー	127,700	2,341.00	298,945,700	
東海理化電機製作所	4,400	2,066.00	9,090,400	
川崎重工業	12,600	5,641.00	71,076,600	
名村造船所	4,700	2,103.00	9,884,100	
日本車輛製造	700	2,350.00	1,645,000	
三菱ロジスネクスト	3,000	1,367.00	4,101,000	
日産自動車	203,700	519.80	105,883,260	
いすゞ自動車	43,500	1,979.00	86,086,500	
トヨタ自動車	849,600	3,036.00	2,579,385,600	代用有価証券 45,000株
日野自動車	23,000	415.90	9,565,700	
三菱自動車工業	61,000	411.60	25,107,600	
レシップホールディングス	1,400	656.00	918,400	
武蔵精密工業	3,600	1,863.00	6,706,800	
日産車体	1,300	990.00	1,287,000	
新明和工業	4,100	1,371.00	5,621,100	
極東開発工業	2,400	2,435.00	5,844,000	
トピー工業	1,200	2,378.00	2,853,600	
ティラド	300	3,465.00	1,039,500	
タチエス	2,900	1,894.00	5,492,600	
NOK	6,100	2,100.00	12,810,000	
フタバ産業	4,900	841.00	4,120,900	
カヤバ	1,600	5,310.00	8,496,000	
大同メタル工業	2,500	597.00	1,492,500	
プレス工業	6,300	626.00	3,943,800	
ミクニ	100	397.00	39,700	
太平洋工業	3,500	1,486.00	5,201,000	
アイシン	11,900	5,397.00	64,224,300	
マツダ	51,200	1,441.00	73,779,200	
本田技研工業	366,700	1,642.50	602,304,750	

スズキ	113,700	1,787.50	203,238,750
S U B A R U	48,000	3,262.00	156,576,000
安永	400	595.00	238,000
ヤマハ発動機	66,900	1,470.00	98,343,000
エクセディ	2,400	2,865.00	6,876,000
豊田合成	4,500	2,702.00	12,159,000
愛三工業	2,700	1,309.00	3,534,300
ヨロズ	1,300	1,116.00	1,450,800
エフ・シー・シー	2,800	2,266.00	6,344,800
シマノ	6,200	25,155.00	155,961,000
テイ・エス テック	5,500	1,849.50	10,172,250
ジャムコ	1,500	1,425.00	2,137,500
テルモ	86,200	2,574.50	221,921,900
日機装	3,500	1,151.00	4,028,500
日本エム・ディ・エム	900	627.00	564,300
島津製作所	20,500	3,917.00	80,298,500
J M S	1,100	531.00	584,100
長野計器	1,300	3,065.00	3,984,500
ブイ・テクノロジー	600	3,120.00	1,872,000
東京計器	1,100	3,395.00	3,734,500
愛知時計電機	900	2,249.00	2,024,100
インターアクション	800	1,589.00	1,271,200
東京精密	3,200	11,825.00	37,840,000
マニー	6,400	1,881.00	12,038,400
ニコン	22,300	1,519.50	33,884,850
トプコン	7,500	1,705.00	12,787,500
オリンパス	88,600	2,600.00	230,360,000
理研計器	2,200	3,805.00	8,371,000
タムロン	1,000	8,460.00	8,460,000
H O Y A	30,500	18,080.00	551,440,000
ノーリツ鋼機	1,300	4,480.00	5,824,000
A & D ホロンホールディングス	2,500	2,773.00	6,932,500
朝日インテック	18,800	2,185.00	41,078,000
シチズン時計	14,200	1,004.00	14,256,800
大研医器	1,800	532.00	957,600
メニコン	5,100	1,266.00	6,456,600
シンシア	1,100	453.00	498,300
松風	700	4,235.00	2,964,500
セイコーグループ	2,100	4,855.00	10,195,500
ニプロ	12,700	1,211.50	15,386,050
スノーピーク	500	1,245.00	622,500
パラマウントベッドホールディングス	3,200	2,733.00	8,745,600

トランザクション	1,300	1,935.00	2,515,500	
粧美堂	500	555.00	277,500	
ニホンフラッシュ	1,100	901.00	991,100	
前田工織	1,400	3,160.00	4,424,000	
アートネイチャー	2,100	814.00	1,709,400	
フルヤ金属	500	13,060.00	6,530,000	
バンダイナムコホールディングス	42,400	2,989.00	126,733,600	
アイフィスジャパン	500	594.00	297,000	
SHOEI	4,500	2,024.00	9,108,000	
フランスベッドホールディングス	1,900	1,168.00	2,219,200	
パイロットコーポレーション	2,200	4,330.00	9,526,000	
萩原工業	800	1,502.00	1,201,600	
フジシールインターナショナル	3,300	2,423.00	7,995,900	
タカラトミー	7,100	3,079.00	21,860,900	
広済堂ホールディングス	5,200	590.00	3,068,000	
プロネクサス	1,600	1,253.00	2,004,800	
TOPPANホールディングス	19,000	4,416.00	83,904,000	
大日本印刷	16,000	5,246.00	83,936,000	
共同印刷	300	3,555.00	1,066,500	
NISSHA	2,500	2,050.00	5,125,000	
TAKARA & COMPANY	1,100	2,961.00	3,257,100	
アシックス	13,200	9,071.00	119,737,200	
ツツミ	300	2,104.00	631,200	
ローランド	1,200	4,085.00	4,902,000	
小松ウオール工業	600	3,165.00	1,899,000	
ヤマハ	9,700	3,682.00	35,715,400	
河合楽器製作所	500	3,235.00	1,617,500	
クリナップ	1,000	715.00	715,000	
ピジョン	10,000	1,507.00	15,070,000	
キングジム	900	896.00	806,400	
リンテック	3,000	3,260.00	9,780,000	
イトーキ	2,800	1,679.00	4,701,200	
任天堂	97,700	8,411.00	821,754,700	代用有価証券 18,000株
三菱鉛筆	2,300	2,504.00	5,759,200	
タカラスタンダード	3,100	1,677.00	5,198,700	
コクヨ	6,300	2,620.00	16,506,000	
ナカバヤシ	1,300	536.00	696,800	
グローブライド	1,600	2,136.00	3,417,600	
オカムラ	4,800	2,155.00	10,344,000	
美津濃	1,500	8,180.00	12,270,000	
東京電力ホールディングス	139,500	855.00	119,272,500	
中部電力	57,000	1,910.00	108,870,000	

関西電力	59,800	2,752.50	164,599,500
中国電力	26,900	1,066.50	28,688,850
北陸電力	16,000	1,058.50	16,936,000
東北電力	40,800	1,460.00	59,568,000
四国電力	14,400	1,426.00	20,534,400
九州電力	35,700	1,723.50	61,528,950
北海道電力	15,000	1,415.50	21,232,500
沖縄電力	3,700	1,101.00	4,073,700
電源開発	12,700	2,505.00	31,813,500
イーレックス	2,200	675.00	1,485,000
レノバ	3,900	1,008.00	3,931,200
東京瓦斯	30,100	3,548.00	106,794,800
大阪瓦斯	30,800	3,515.00	108,262,000
東邦瓦斯	6,700	4,035.00	27,034,500
北海道瓦斯	1,000	3,415.00	3,415,000
広島ガス	3,000	380.00	1,140,000
西部ガスホールディングス	1,800	1,981.00	3,565,800
静岡ガス	3,500	935.00	3,272,500
メタウォーター	1,900	1,902.00	3,613,800
SBSホールディングス	1,500	2,679.00	4,018,500
東武鉄道	17,000	2,612.00	44,404,000
相鉄ホールディングス	5,600	2,331.00	13,053,600
東急	43,400	1,753.50	76,101,900
京浜急行電鉄	19,100	1,130.50	21,592,550
小田急電鉄	25,600	1,508.00	38,604,800
京王電鉄	7,400	3,541.00	26,203,400
京成電鉄	10,000	5,342.00	53,420,000
富士急行	2,000	2,770.00	5,540,000
東日本旅客鉄道	85,300	2,505.50	213,719,150
西日本旅客鉄道	36,700	2,890.00	106,063,000
東海旅客鉄道	59,600	3,289.00	196,024,400
西武ホールディングス	18,700	2,188.50	40,924,950
鴻池運輸	2,700	2,365.00	6,385,500
西日本鉄道	4,200	2,511.50	10,548,300
ハマキョウレックス	1,300	4,190.00	5,447,000
サカイ引越センター	1,800	2,449.00	4,408,200
近鉄グループホールディングス	15,500	3,257.00	50,483,500
阪急阪神ホールディングス	20,600	3,952.00	81,411,200
南海電気鉄道	6,900	2,533.50	17,481,150
京阪ホールディングス	8,500	2,776.00	23,596,000
神戸電鉄	300	2,724.00	817,200
名古屋鉄道	16,000	1,683.50	26,936,000

山陽電気鉄道	1,100	2,046.00	2,250,600
アルプス物流	1,200	5,710.00	6,852,000
ヤマトホールディングス	18,800	1,669.00	31,377,200
山九	3,700	5,378.00	19,898,600
丸全昭和運輸	1,000	5,080.00	5,080,000
センコーグループホールディングス	8,300	1,108.00	9,196,400
トナミホールディングス	300	5,490.00	1,647,000
ニッコンホールディングス	4,800	2,988.00	14,342,400
福山通運	1,600	4,060.00	6,496,000
セイノーホールディングス	8,700	2,062.50	17,943,750
神奈川中央交通	400	3,025.00	1,210,000
A Z - C O M丸和ホールディングス	4,100	1,173.00	4,809,300
C & F ロジホールディングス	1,500	5,730.00	8,595,000
九州旅客鉄道	10,900	3,326.00	36,253,400
S Gホールディングス	26,000	1,461.50	37,999,000
N I P P O N E X P R E S Sホールディングス	5,200	7,275.00	37,830,000
日本郵船	40,000	4,677.00	187,080,000
商船三井	33,600	4,850.00	162,960,000
川崎汽船	37,300	2,270.00	84,671,000
N Sユナイテッド海運	900	4,780.00	4,302,000
飯野海運	5,900	1,269.00	7,487,100
乾汽船	1,400	1,105.00	1,547,000
日本航空	37,900	2,462.00	93,309,800
A N Aホールディングス	42,000	2,888.50	121,317,000
パスコ	200	1,757.00	351,400
トランコム	400	6,330.00	2,532,000
日新	1,200	4,505.00	5,406,000
三菱倉庫	3,700	5,163.00	19,103,100
三井倉庫ホールディングス	1,500	4,485.00	6,727,500
住友倉庫	4,100	2,534.00	10,389,400
澁澤倉庫	500	3,020.00	1,510,000
日本トランスシティ	2,400	959.00	2,301,600
中央倉庫	900	1,210.00	1,089,000
川西倉庫	300	1,190.00	357,000
安田倉庫	800	1,623.00	1,298,400
ファイズホールディングス	400	1,047.00	418,800
上組	7,100	3,283.00	23,309,300
キムラユニティー	600	1,705.00	1,023,000
キューソー流通システム	500	1,644.00	822,000
エーアイティー	1,300	1,815.00	2,359,500
内外トランスライン	800	2,702.00	2,161,600
日本コンセプト	900	1,901.00	1,710,900

NEC ネットズエスアイ	6,000	2,309.00	13,854,000
クロスキャット	1,300	1,366.00	1,775,800
システナ	24,300	294.00	7,144,200
デジタルアーツ	1,000	3,845.00	3,845,000
日鉄ソリューションズ	2,600	5,130.00	13,338,000
キューブシステム	1,100	1,127.00	1,239,700
コア	900	1,873.00	1,685,700
手間いらず	100	3,000.00	300,000
ラクーンホールディングス	600	560.00	336,000
ソリトンシステムズ	1,100	1,139.00	1,252,900
ソフトクリエイティブホールディングス	1,400	2,002.00	2,802,800
T I S	16,300	2,840.50	46,300,150
グリー	5,500	530.00	2,915,000
コーエーテクモホールディングス	9,800	1,368.00	13,406,400
三菱総合研究所	800	4,740.00	3,792,000
電算	200	1,482.00	296,400
A G S	500	996.00	498,000
ファインデックス	1,700	1,060.00	1,802,000
K L a b	1,300	228.00	296,400
ポルトゥウィンホールディングス	1,300	494.00	642,200
ネクソン	34,000	2,906.00	98,804,000
アイスタイル	4,600	504.00	2,318,400
エムアップホールディングス	2,200	1,340.00	2,948,000
エニグモ	1,800	320.00	576,000
テクノスジャパン	1,200	636.00	763,200
コロプラ	4,700	621.00	2,918,700
ブロードリーフ	6,400	536.00	3,430,400
クロス・マーケティンググループ	300	611.00	183,300
デジタルハーツホールディングス	400	1,065.00	426,000
メディアドゥ	600	1,459.00	875,400
じげん	5,000	617.00	3,085,000
フィックスターズ	1,800	1,895.00	3,411,000
C A R T A H O L D I N G S	300	1,591.00	477,300
オブティム	2,100	640.00	1,344,000
セレス	300	1,952.00	585,600
S H I F T	1,000	15,245.00	15,245,000
ティーガイア	1,700	1,969.00	3,347,300
セック	300	4,480.00	1,344,000
テクマトリックス	2,900	1,914.00	5,550,600
プロシップ	1,000	1,399.00	1,399,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	4,100	2,764.00	11,332,400
G M O ペイメントゲートウェイ	3,500	8,026.00	28,091,000

システムリサーチ	1,300	1,537.00	1,998,100
インターネットイニシアティブ	7,400	2,174.50	16,091,300
さくらインターネット	1,700	4,950.00	8,415,000
GMOグローバルサイン・ホールディングス	400	3,010.00	1,204,000
SRAホールディングス	700	3,995.00	2,796,500
システムインテグレータ	700	371.00	259,700
朝日ネット	2,100	642.00	1,348,200
eBASE	2,900	703.00	2,038,700
アバントグループ	2,200	1,337.00	2,941,400
アドソル日進	900	1,801.00	1,620,900
フリービット	1,000	1,187.00	1,187,000
コムチュア	2,400	1,788.00	4,291,200
アステリア	600	532.00	319,200
アイル	1,000	2,441.00	2,441,000
マークライنز	900	2,961.00	2,664,900
メディカル・データ・ビジョン	2,600	572.00	1,487,200
gumi	1,500	322.00	483,000
テラスカイ	400	1,950.00	780,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	1,100	1,836.00	2,019,600
PCIホールディングス	300	967.00	290,100
ネオジャパン	900	1,646.00	1,481,400
PR TIMES	600	1,839.00	1,103,400
ラクス	7,400	1,894.50	14,019,300
ランドコンピュータ	500	805.00	402,500
ダブルスタンダード	800	1,681.00	1,344,800
アカツキ	500	2,302.00	1,151,000
ベネフィットジャパン	200	1,203.00	240,600
Ubicomホールディングス	800	1,261.00	1,008,800
カナミックネットワーク	2,700	579.00	1,563,300
ノムラシステムコーポレーション	1,200	131.00	157,200
チェンジホールディングス	3,600	1,157.00	4,165,200
シンクロ・フード	700	507.00	354,900
オークネット	800	2,580.00	2,064,000
エイトレッド	200	1,565.00	313,000
マクロミル	3,500	876.00	3,066,000
ビーグリー	100	1,066.00	106,600
オロ	800	2,462.00	1,969,600
ユーザーローカル	900	1,969.00	1,772,100
マネーフォワード	3,400	5,128.00	17,435,200
Sun Asterisk	1,600	866.00	1,385,600
プラスアルファ・コンサルティング	2,100	1,788.00	3,754,800
電算システムホールディングス	800	2,649.00	2,119,200

Appier Group	4,800	1,268.00	6,086,400
ビジョナル	1,800	7,150.00	12,870,000
ソルクシーズ	700	322.00	225,400
プロトコーポレーション	1,900	1,400.00	2,660,000
ハイマックス	800	1,342.00	1,073,600
野村総合研究所	33,500	4,221.00	141,403,500
CEホールディングス	400	580.00	232,000
日本システム技術	1,500	1,571.00	2,356,500
インテージホールディングス	1,500	1,411.00	2,116,500
東邦システムサイエンス	1,000	1,605.00	1,605,000
ソースネクスト	3,400	194.00	659,600
インフォコム	2,100	5,740.00	12,054,000
シンプレクス・ホールディングス	2,400	2,791.00	6,698,400
HEROZ	400	1,222.00	488,800
ラクスル	4,000	960.00	3,840,000
メルカリ	7,600	2,094.00	15,914,400
IPS	600	2,187.00	1,312,200
システムサポート	800	1,713.00	1,370,400
イーソル	700	910.00	637,000
東海ソフト	200	1,290.00	258,000
ウイングアーク1st	1,700	2,721.00	4,625,700
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	400	881.00	352,400
サーバーワークス	100	3,215.00	321,500
東名	100	2,388.00	238,800
トピラシステムズ	300	785.00	235,500
Sansan	4,800	1,683.00	8,078,400
Link-Uグループ	200	596.00	119,200
ギフトィ	800	1,109.00	887,200
メドレー	2,100	3,650.00	7,665,000
ベース	700	2,764.00	1,934,800
JMDC	2,500	3,374.00	8,435,000
フォーカスシステムズ	1,000	1,141.00	1,141,000
クレスコ	1,400	2,330.00	3,262,000
フジ・メディア・ホールディングス	14,800	1,809.00	26,773,200
オービック	5,200	20,355.00	105,846,000
ジャストシステム	2,300	2,900.00	6,670,000
TDCソフト	3,200	1,040.00	3,328,000
LINEヤフー	220,300	364.60	80,321,380
トレンドマイクロ	7,300	6,567.00	47,939,100
IDホールディングス	1,300	1,418.00	1,843,400
日本オラクル	3,000	11,750.00	35,250,000
アルファシステムズ	400	3,000.00	1,200,000

フューチャー	3,400	1,497.00	5,089,800	
C A C H o l d i n g s	1,000	1,932.00	1,932,000	
S B テクノロジー	900	2,943.00	2,648,700	
オービックビジネスコンサルタント	2,200	6,221.00	13,686,200	
アイティフォー	2,200	1,400.00	3,080,000	
東計電算	500	3,715.00	1,857,500	
エクスネット	100	1,488.00	148,800	
大塚商会	15,300	2,885.50	44,148,150	
サイボウズ	2,400	1,828.00	4,387,200	
電通総研	1,900	5,330.00	10,127,000	
A C C E S S	1,100	1,394.00	1,533,400	
デジタルガレージ	2,300	2,181.00	5,016,300	
E M システムズ	3,000	627.00	1,881,000	
ウェザーニューズ	600	4,480.00	2,688,000	
C I J	3,400	452.00	1,536,800	
ビジネスエンジニアリング	400	3,480.00	1,392,000	
WOWOW	700	1,075.00	752,500	
スカラ	600	715.00	429,000	
インテリジェント ウェイブ	500	1,022.00	511,000	
A N Y C O L O R	2,300	2,812.00	6,467,600	
I M A G I C A G R O U P	1,300	538.00	699,400	
ネットワンシステムズ	6,000	2,624.00	15,744,000	
アルゴグラフィックス	1,500	4,525.00	6,787,500	
マーベラス	1,500	631.00	946,500	
エイベックス	2,400	1,200.00	2,880,000	
B I P R O G Y	5,100	4,175.00	21,292,500	
都築電気	1,000	2,303.00	2,303,000	
T B S ホールディングス	7,700	3,954.00	30,445,800	
日本テレビホールディングス	13,600	2,215.00	30,124,000	
朝日放送グループホールディングス	500	660.00	330,000	
テレビ朝日ホールディングス	3,500	2,069.00	7,241,500	
スカパーJ S A T ホールディングス	11,900	858.00	10,210,200	
テレビ東京ホールディングス	1,100	3,375.00	3,712,500	
ビジョン	2,600	1,170.00	3,042,000	
U - N E X T H O L D I N G S	1,800	4,700.00	8,460,000	
日本通信	17,200	187.00	3,216,400	
クロップス	100	1,141.00	114,100	
日本電信電話	4,614,400	144.90	668,626,560	代用有価証券 700,000株
K D D I	119,900	4,175.00	500,582,500	
ソフトバンク	247,700	1,945.50	481,900,350	
光通信	1,600	27,850.00	44,560,000	
エムティーアイ	1,800	824.00	1,483,200	

GMOインターネットグループ	5,700	2,386.00	13,600,200
ファイバーゲート	1,300	1,047.00	1,361,100
KADOKAWA	8,100	2,851.50	23,097,150
学研ホールディングス	2,500	980.00	2,450,000
ゼンリン	1,800	906.00	1,630,800
アイネット	800	2,116.00	1,692,800
松竹	700	9,368.00	6,557,600
東宝	8,600	4,589.00	39,465,400
東映	2,500	3,670.00	9,175,000
NTTデータグループ	40,500	2,211.00	89,545,500
ピー・シー・エー	800	2,246.00	1,796,800
ビジネスブレイン太田昭和	800	2,149.00	1,719,200
DTS	3,300	4,135.00	13,645,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	7,000	4,511.00	31,577,000
シーイーシー	1,800	2,135.00	3,843,000
カプコン	27,700	2,857.50	79,152,750
アイ・エス・ビー	1,000	1,385.00	1,385,000
ジャステック	1,100	1,934.00	2,127,400
SCSK	10,800	3,068.00	33,134,400
NSW	800	3,135.00	2,508,000
アイネス	800	1,673.00	1,338,400
TKC	2,800	3,245.00	9,086,000
富士ソフト	3,100	6,870.00	21,297,000
NSD	5,500	3,045.00	16,747,500
コナミグループ	5,800	10,770.00	62,466,000
福井コンピュータホールディングス	1,100	2,364.00	2,600,400
JBCホールディングス	1,100	3,235.00	3,558,500
ミロク情報サービス	1,500	1,837.00	2,755,500
ソフトバンクグループ	76,500	10,120.00	774,180,000
リョーサン菱洋ホールディングス	3,000	3,070.00	9,210,000
高千穂交易	500	3,800.00	1,900,000
オルバヘルスケアホールディングス	300	2,135.00	640,500
伊藤忠食品	300	7,240.00	2,172,000
エレマテック	1,400	1,984.00	2,777,600
あらた	2,600	3,375.00	8,775,000
トーメンデバイス	200	7,680.00	1,536,000
東京エレクトロン デバイス	1,700	4,140.00	7,038,000
円谷フィールズホールディングス	3,000	1,720.00	5,160,000
双日	18,200	3,838.00	69,851,600
アルフレッサ ホールディングス	16,400	2,120.00	34,768,000
横浜冷凍	3,800	1,016.00	3,860,800
神栄	300	1,827.00	548,100

ラサ商事	800	1,741.00	1,392,800
アルコニックス	2,000	1,475.00	2,950,000
神戸物産	12,600	3,459.00	43,583,400
あいホールディングス	2,700	2,402.00	6,485,400
ダイワボウホールディングス	7,200	2,679.00	19,288,800
マクニカホールディングス	3,900	6,422.00	25,045,800
ラクト・ジャパン	800	2,926.00	2,340,800
グリムス	1,000	2,515.00	2,515,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,400	1,331.00	3,194,400
八洲電機	1,500	1,593.00	2,389,500
メディアスホールディングス	800	967.00	773,600
レスター	1,300	3,130.00	4,069,000
ジオリーブグループ	400	1,190.00	476,000
大光	800	609.00	487,200
O C H Iホールディングス	300	1,441.00	432,300
T O K A Iホールディングス	9,200	956.00	8,795,200
三洋貿易	1,900	1,524.00	2,895,600
ビューティガレージ	800	1,592.00	1,273,600
ウイン・パートナーズ	1,100	1,182.00	1,300,200
シップヘルスケアホールディングス	5,900	2,281.50	13,460,850
明治電機工業	600	1,719.00	1,031,400
デリカフーズホールディングス	600	569.00	341,400
スターティアホールディングス	500	2,103.00	1,051,500
コメダホールディングス	4,100	2,718.00	11,143,800
アセンテック	1,600	559.00	894,400
フルサト・マルカホールディングス	1,400	2,124.00	2,973,600
ヤマエグループホールディングス	1,500	2,394.00	3,591,000
小野建	1,600	1,583.00	2,532,800
南陽	200	1,096.00	219,200
佐島電機	800	2,022.00	1,617,600
エコートレーディング	200	1,313.00	262,600
伯東	900	5,120.00	4,608,000
コンドーテック	1,500	1,363.00	2,044,500
ナガイレーベン	2,000	2,482.00	4,964,000
三菱食品	1,500	5,370.00	8,055,000
松田産業	1,200	2,765.00	3,318,000
第一興商	6,400	1,616.50	10,345,600
メディバルホールディングス	16,600	2,344.50	38,918,700
S P K	700	2,197.00	1,537,900
萩原電気ホールディングス	700	4,100.00	2,870,000
アズワン	5,100	2,613.00	13,326,300
スズデン	800	1,935.00	1,548,000

シモジマ	1,100	1,288.00	1,416,800
ドウシシャ	1,500	2,235.00	3,352,500
高速	1,100	2,241.00	2,465,100
たけびし	600	2,145.00	1,287,000
リックス	500	2,970.00	1,485,000
丸文	1,100	1,258.00	1,383,800
ハピネット	1,500	3,760.00	5,640,000
橋本総業ホールディングス	700	1,349.00	944,300
日本ライフライン	4,600	1,067.00	4,908,200
タカショー	1,100	510.00	561,000
I D O M	4,600	1,376.00	6,329,600
進和	800	2,789.00	2,231,200
エスケイジャパン	400	870.00	348,000
ダイトロン	700	2,982.00	2,087,400
シークス	2,200	1,302.00	2,864,400
オーハシテクニカ	500	1,713.00	856,500
白銅	500	2,915.00	1,457,500
ダイコー通産	200	1,182.00	236,400
伊藤忠商事	110,000	7,379.00	811,690,000
丸紅	135,800	2,982.00	404,955,600
高島	400	1,038.00	415,200
長瀬産業	7,400	2,997.00	22,177,800
蝶理	1,100	3,475.00	3,822,500
豊田通商	14,300	8,812.00	126,011,600
三共生興	1,700	723.00	1,229,100
兼松	6,800	2,588.00	17,598,400
三井物産	122,600	7,430.00	910,918,000
日本紙パルプ商事	800	5,910.00	4,728,000
カメイ	1,600	2,159.00	3,454,400
東都水産	100	6,460.00	646,000
O U G ホールディングス	200	2,723.00	544,600
スターゼン	1,300	2,755.00	3,581,500
山善	4,800	1,432.00	6,873,600
椿本興業	1,200	2,148.00	2,577,600
住友商事	99,100	3,899.00	386,390,900
内田洋行	700	7,540.00	5,278,000
三菱商事	314,300	3,080.00	968,044,000
第一実業	1,500	2,331.00	3,496,500
キャノンマーケティングジャパン	3,800	4,411.00	16,761,800
西華産業	700	4,435.00	3,104,500
佐藤商事	1,300	1,624.00	2,111,200
東京産業	800	666.00	532,800

ユアサ商事	1,300	5,480.00	7,124,000
神鋼商事	400	7,270.00	2,908,000
阪和興業	2,900	5,930.00	17,197,000
正栄食品工業	1,100	4,615.00	5,076,500
カナデン	1,100	1,571.00	1,728,100
RYODEN	1,300	2,609.00	3,391,700
岩谷産業	3,700	9,243.00	34,199,100
ナイス	400	1,860.00	744,000
ニチモウ	200	2,104.00	420,800
極東貿易	700	1,711.00	1,197,700
アステナホールディングス	1,900	485.00	921,500
三愛オブリ	3,900	2,113.00	8,240,700
稲畑産業	3,300	3,380.00	11,154,000
G S Iクレオス	700	2,156.00	1,509,200
明和産業	1,300	712.00	925,600
ワキタ	2,600	1,702.00	4,425,200
東邦ホールディングス	4,400	3,842.00	16,904,800
サンゲツ	3,800	3,040.00	11,552,000
ミツウロコグループホールディングス	2,400	1,573.00	3,775,200
シナネンホールディングス	300	4,730.00	1,419,000
伊藤忠エネクス	4,200	1,505.00	6,321,000
サンリオ	13,300	2,771.50	36,860,950
サンワテクノス	1,000	2,264.00	2,264,000
新光商事	2,000	955.00	1,910,000
トーヨー	700	3,740.00	2,618,000
三信電気	700	2,105.00	1,473,500
東陽テクニカ	1,400	1,596.00	2,234,400
モスフードサービス	2,300	3,600.00	8,280,000
加賀電子	1,500	5,560.00	8,340,000
ソーダニッカ	1,200	1,101.00	1,321,200
立花エレテック	1,100	3,080.00	3,388,000
フォーバル	1,200	1,429.00	1,714,800
PALTAC	2,200	4,341.00	9,550,200
三谷産業	2,700	350.00	945,000
西本Wismettacホールディングス	400	4,355.00	1,742,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	100	2,633.00	263,300
コーア商事ホールディングス	1,800	690.00	1,242,000
KPPグループホールディングス	4,100	797.00	3,267,700
ヤマタネ	700	2,855.00	1,998,500
泉州電業	1,000	5,230.00	5,230,000
トラスコ中山	3,300	2,377.00	7,844,100
オートバックスセブン	5,800	1,514.50	8,784,100

モリト	900	1,414.00	1,272,600
加藤産業	2,100	4,220.00	8,862,000
イエローハット	2,700	2,121.00	5,726,700
J Kホールディングス	1,300	1,003.00	1,303,900
日伝	1,000	3,630.00	3,630,000
杉本商事	600	2,393.00	1,435,800
因幡電機産業	4,300	3,800.00	16,340,000
東テク	1,700	2,495.00	4,241,500
ミスミグループ本社	24,700	2,627.00	64,886,900
蔵王産業	100	2,564.00	256,400
スズケン	5,800	4,629.00	26,848,200
ジェコス	900	977.00	879,300
サンエー	1,300	4,840.00	6,292,000
カワチ薬品	1,200	2,810.00	3,372,000
エービーシー・マート	7,200	2,809.50	20,228,400
ハードオフコーポレーション	900	2,143.00	1,928,700
アスクル	4,100	2,175.00	8,917,500
ゲオホールディングス	1,700	1,563.00	2,657,100
アダストリア	2,100	3,480.00	7,308,000
シー・ヴィ・エス・バイエリア	500	635.00	317,500
くら寿司	1,900	4,300.00	8,170,000
キャンドウ	500	3,165.00	1,582,500
パルグループホールディングス	3,300	1,782.00	5,880,600
エディオン	6,500	1,578.00	10,257,000
サーラコーポレーション	3,100	800.00	2,480,000
ハローズ	800	4,250.00	3,400,000
フジオフードグループ本社	1,400	1,479.00	2,070,600
あみやき亭	400	6,080.00	2,432,000
大黒天物産	500	8,410.00	4,205,000
ハニーズホールディングス	1,600	1,582.00	2,531,200
ファーマライズホールディングス	300	640.00	192,000
アルペン	1,300	2,048.00	2,662,400
ハブ	500	869.00	434,500
クオールホールディングス	2,400	1,431.00	3,434,400
ジinzホールディングス	1,300	3,885.00	5,050,500
ビックカメラ	10,000	1,613.00	16,130,000
D C Mホールディングス	8,700	1,468.00	12,771,600
Monotaro	23,300	1,859.00	43,314,700
東京一番フーズ	300	512.00	153,600
J.フロント リテイリング	18,900	1,640.50	31,005,450
ドトール・日レスホールディングス	2,800	2,179.00	6,101,200
マツキヨココカラ&カンパニー	29,900	2,150.50	64,299,950

ブロンコピラー	900	3,920.00	3,528,000
Z O Z O	10,500	3,816.00	40,068,000
トレジャー・ファクトリー	1,300	1,771.00	2,302,300
物語コーポレーション	2,800	3,430.00	9,604,000
三越伊勢丹ホールディングス	27,300	3,138.00	85,667,400
H a m e e	1,000	1,130.00	1,130,000
ウエルシアホールディングス	8,500	1,993.50	16,944,750
クリエイティブSDホールディングス	2,400	3,545.00	8,508,000
丸善C H Iホールディングス	400	338.00	135,200
ティーライフ	200	1,427.00	285,400
シュッピン	1,800	1,335.00	2,403,000
オイシックス・ラ・大地	2,400	1,183.00	2,839,200
ネクステージ	3,800	2,417.00	9,184,600
ジョイフル本田	4,800	2,129.00	10,219,200
エターナルホスピタリティグループ	700	3,675.00	2,572,500
ホットランド	1,400	2,531.00	3,543,400
すかいらーくホールディングス	22,500	2,271.00	51,097,500
S F Pホールディングス	700	2,094.00	1,465,800
綿半ホールディングス	1,400	1,661.00	2,325,400
ヨシックスホールディングス	600	2,835.00	1,701,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	4,500	872.00	3,924,000
B E E N O S	1,100	2,300.00	2,530,000
あさひ	1,700	1,480.00	2,516,000
日本調剤	1,000	1,405.00	1,405,000
コスモス薬品	1,400	12,720.00	17,808,000
トーエル	600	814.00	488,400
セブン&アイ・ホールディングス	167,700	1,997.50	334,980,750
クリエイティブ・レストランズ・ホールディングス	11,300	1,118.00	12,633,400
ツルハホールディングス	3,500	9,049.00	31,671,500
サンマルクホールディングス	1,000	2,149.00	2,149,000
トリドールホールディングス	4,600	3,577.00	16,454,200
ウイルプラスホールディングス	300	1,135.00	340,500
J Mホールディングス	1,400	2,769.00	3,876,600
アレンザホールディングス	1,200	1,098.00	1,317,600
串カツ田中ホールディングス	800	1,665.00	1,332,000
パロックジャパンリミテッド	1,200	797.00	956,400
クスリのアオキホールディングス	5,000	3,095.00	15,475,000
力の源ホールディングス	1,200	1,461.00	1,753,200
F O O D & L I F E C O M P A N I E	8,800	2,599.50	22,875,600
メディカルシステムネットワーク	2,500	579.00	1,447,500
一家ホールディングス	400	682.00	272,800

ノジマ	4,800	1,569.00	7,531,200
カップ・クリエイト	2,500	1,700.00	4,250,000
良品計画	19,600	2,704.00	52,998,400
アドヴァングループ	1,900	955.00	1,814,500
アルビス	500	2,602.00	1,301,000
ハウス オブ ローゼ	200	1,588.00	317,600
G - 7ホールディングス	2,000	1,506.00	3,012,000
イオン北海道	5,000	909.00	4,545,000
コジマ	2,900	914.00	2,650,600
コーナン商事	2,000	4,080.00	8,160,000
エコス	800	2,234.00	1,787,200
ワタミ	2,200	897.00	1,973,400
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	33,100	3,708.00	122,734,800
西松屋チェーン	3,300	2,176.00	7,180,800
ゼンショーホールディングス	8,400	6,076.00	51,038,400
サイゼリヤ	2,500	5,240.00	13,100,000
V Tホールディングス	7,000	486.00	3,402,000
魚力	700	2,438.00	1,706,600
フジ・コーポレーション	1,100	2,095.00	2,304,500
ユナイテッドアローズ	2,100	1,903.00	3,996,300
ハイデイ日高	2,500	3,060.00	7,650,000
コロワイド	7,200	2,013.00	14,493,600
壱番屋	6,600	1,131.00	7,464,600
スギホールディングス	9,900	2,335.50	23,121,450
薬王堂ホールディングス	900	2,803.00	2,522,700
スクロール	2,700	1,056.00	2,851,200
ヨンドシーホールディングス	1,400	1,908.00	2,671,200
木曽路	2,400	2,538.00	6,091,200
S R Sホールディングス	2,800	1,273.00	3,564,400
千趣会	2,500	321.00	802,500
リテールパートナーズ	2,400	1,595.00	3,828,000
上新電機	1,600	2,559.00	4,094,400
日本瓦斯	8,700	2,363.50	20,562,450
ロイヤルホールディングス	2,900	2,595.00	7,525,500
いなげや	1,100	1,242.00	1,366,200
チヨダ	1,000	894.00	894,000
ライフコーポレーション	1,800	3,950.00	7,110,000
リンガーハット	2,200	2,366.00	5,205,200
MrMaxHD	2,700	657.00	1,773,900
AOKIホールディングス	3,400	1,232.00	4,188,800
オークワ	1,800	938.00	1,688,400
コメリ	2,600	3,490.00	9,074,000

青山商事	3,600	1,456.00	5,241,600
しまむら	3,900	7,167.00	27,951,300
はせがわ	800	357.00	285,600
高島屋	10,500	2,602.00	27,321,000
松屋	2,500	1,046.00	2,615,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	7,300	2,279.00	16,636,700
近鉄百貨店	800	2,295.00	1,836,000
丸井グループ	11,000	2,235.50	24,590,500
アクシアル リテイリング	4,600	1,004.00	4,618,400
イオン	55,600	3,424.00	190,374,400
イズミ	2,900	3,133.00	9,085,700
平和堂	2,600	2,268.00	5,896,800
フジ	2,600	2,011.00	5,228,600
ヤオコー	1,900	9,765.00	18,553,500
ゼビオホールディングス	1,700	1,200.00	2,040,000
ケーズホールディングス	11,200	1,409.50	15,786,400
日産東京販売ホールディングス	1,700	494.00	839,800
シルバーライフ	900	969.00	872,100
Genky DrugStores	800	5,650.00	4,520,000
ナルミヤ・インターナショナル	200	1,321.00	264,200
ブックオフグループホールディングス	1,300	1,586.00	2,061,800
ギフトホールディングス	800	2,626.00	2,100,800
アインホールディングス	2,300	5,723.00	13,162,900
元気寿司	1,100	3,205.00	3,525,500
ヤマダホールディングス	50,600	424.30	21,469,580
アークランズ	4,900	1,895.00	9,285,500
ニトリホールディングス	6,000	16,760.00	100,560,000
ケーユーホールディングス	1,200	1,254.00	1,504,800
吉野家ホールディングス	6,100	3,018.00	18,409,800
松屋フーズホールディングス	800	5,730.00	4,584,000
サガミホールディングス	2,400	1,613.00	3,871,200
関西フードマーケット	1,300	2,373.00	3,084,900
王将フードサービス	1,200	8,700.00	10,440,000
ミニストップ	800	1,718.00	1,374,400
アークス	3,000	2,862.00	8,586,000
バローホールディングス	3,000	2,367.00	7,101,000
ベルク	800	7,280.00	5,824,000
大庄	700	1,230.00	861,000
ファーストリテイリング	9,200	39,460.00	363,032,000
サンドラッグ	5,500	3,923.00	21,576,500
サックスパー ホールディングス	1,300	772.00	1,003,600
やまや	300	3,075.00	922,500

ペルーナ	3,500	742.00	2,597,000	
いよぎんホールディングス	18,100	1,389.00	25,140,900	
しずおかフィナンシャルグループ	33,900	1,429.50	48,460,050	
ちゅうぎんフィナンシャルグループ	12,800	1,589.50	20,345,600	
楽天銀行	7,200	2,706.00	19,483,200	
京都フィナンシャルグループ	19,200	2,557.50	49,104,000	
じもとホールディングス	700	350.00	245,000	
めぶきフィナンシャルグループ	70,600	585.90	41,364,540	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,000	4,500.00	9,000,000	
九州フィナンシャルグループ	29,500	930.70	27,455,650	
ゆうちょ銀行	167,500	1,464.50	245,303,750	
富山第一銀行	4,800	1,149.00	5,515,200	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	81,100	881.20	71,465,320	
西日本フィナンシャルホールディングス	8,500	1,877.00	15,954,500	
三十三フィナンシャルグループ	1,400	2,035.00	2,849,000	
第四北越フィナンシャルグループ	2,400	4,900.00	11,760,000	
ひろぎんホールディングス	21,700	1,182.50	25,660,250	
おきなわフィナンシャルグループ	1,300	2,456.00	3,192,800	
十六フィナンシャルグループ	2,000	4,415.00	8,830,000	
北國フィナンシャルホールディングス	1,600	5,240.00	8,384,000	
プロクレアホールディングス	1,700	1,806.00	3,070,200	
あいちフィナンシャルグループ	3,400	2,708.00	9,207,200	
あおぞら銀行	10,900	2,595.00	28,285,500	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	928,100	1,544.50	1,433,450,450	代用有価証券 90,000株
りそなホールディングス	176,200	971.60	171,195,920	
三井住友トラスト・ホールディングス	54,800	3,522.00	193,005,600	
三井住友フィナンシャルグループ	106,700	9,860.00	1,052,062,000	
千葉銀行	42,500	1,359.50	57,778,750	
群馬銀行	29,600	967.00	28,623,200	
武蔵野銀行	2,100	3,130.00	6,573,000	
千葉興業銀行	3,200	977.00	3,126,400	
筑波銀行	6,500	304.00	1,976,000	
七十七銀行	4,400	4,235.00	18,634,000	
秋田銀行	1,000	2,590.00	2,590,000	
山形銀行	1,600	1,139.00	1,822,400	
岩手銀行	900	2,788.00	2,509,200	
東邦銀行	12,000	316.00	3,792,000	
東北銀行	400	1,179.00	471,600	
ふくおかフィナンシャルグループ	13,300	4,050.00	53,865,000	
スルガ銀行	11,500	1,032.00	11,868,000	
八十二銀行	32,700	994.90	32,533,230	
山梨中央銀行	1,700	1,875.00	3,187,500	

大垣共立銀行	2,800	2,134.00	5,975,200
福井銀行	1,300	2,007.00	2,609,100
清水銀行	600	1,620.00	972,000
滋賀銀行	2,600	4,245.00	11,037,000
南都銀行	2,200	3,370.00	7,414,000
百五銀行	14,100	656.00	9,249,600
紀陽銀行	5,400	1,870.00	10,098,000
ほくほくフィナンシャルグループ	9,400	2,044.50	19,218,300
山陰合同銀行	9,600	1,347.00	12,931,200
鳥取銀行	200	1,370.00	274,000
百十四銀行	1,500	3,270.00	4,905,000
四国銀行	2,200	1,099.00	2,417,800
阿波銀行	2,100	2,667.00	5,600,700
大分銀行	900	3,330.00	2,997,000
宮崎銀行	900	3,355.00	3,019,500
佐賀銀行	900	2,533.00	2,279,700
琉球銀行	3,200	1,194.00	3,820,800
セブン銀行	50,900	259.30	13,198,370
みずほフィナンシャルグループ	205,700	3,024.00	622,036,800
山口フィナンシャルグループ	14,900	1,710.00	25,479,000
名古屋銀行	900	7,230.00	6,507,000
北洋銀行	23,300	529.00	12,325,700
大光銀行	200	1,578.00	315,600
愛媛銀行	2,000	1,232.00	2,464,000
トマト銀行	300	1,224.00	367,200
京葉銀行	6,200	854.00	5,294,800
栃木銀行	7,400	354.00	2,619,600
北日本銀行	500	2,539.00	1,269,500
東和銀行	2,700	685.00	1,849,500
大東銀行	300	743.00	222,900
トモニホールディングス	14,300	397.00	5,677,100
フィデアホールディングス	1,500	1,574.00	2,361,000
池田泉州ホールディングス	21,000	388.00	8,148,000
F P G	6,000	2,094.00	12,564,000
ジャパンインベストメントアドバイザー	2,300	1,457.00	3,351,100
マーキュリアホールディングス	200	919.00	183,800
S B Iホールディングス	24,400	3,932.00	95,940,800
ジャフコ グループ	4,400	1,877.50	8,261,000
大和証券グループ本社	118,000	1,169.00	137,942,000
野村ホールディングス	256,100	898.00	229,977,800
岡三証券グループ	13,000	772.00	10,036,000
丸三証券	4,900	991.00	4,855,900

東洋証券	3,600	376.00	1,353,600
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	18,000	569.00	10,242,000
水戸証券	4,000	535.00	2,140,000
いちよし証券	2,600	817.00	2,124,200
松井証券	8,400	797.00	6,694,800
マネックスグループ	14,900	715.00	10,653,500
極東証券	2,100	1,417.00	2,975,700
岩井コスモホールディングス	1,900	2,160.00	4,104,000
アイザワ証券グループ	2,100	2,216.00	4,653,600
スパークス・グループ	2,300	1,642.00	3,776,600
かんぽ生命保険	15,500	2,922.50	45,298,750
F Pパートナー	500	3,265.00	1,632,500
S O M P Oホールディングス	68,800	3,163.00	217,614,400
アニコム ホールディングス	5,300	640.00	3,392,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	102,400	3,059.00	313,241,600
第一生命ホールディングス	71,600	3,864.00	276,662,400
東京海上ホールディングス	148,800	5,263.00	783,134,400
T & Dホールディングス	40,900	2,590.00	105,931,000
アドバンスクリエイト	800	1,056.00	844,800
N E X Y Z . G r o u p	700	604.00	422,800
全国保証	4,000	5,678.00	22,712,000
あんしん保証	2,000	219.00	438,000
ジェイリース	1,600	1,263.00	2,020,800
イントラスト	700	800.00	560,000
日本モーゲージサービス	900	416.00	374,400
S B Iアルヒ	1,000	861.00	861,000
プレミアグループ	2,800	2,048.00	5,734,400
ネットプロテクションズホールディングス	2,800	199.00	557,200
クレディセゾン	9,600	3,316.00	31,833,600
芙蓉総合リース	1,400	11,780.00	16,492,000
みずほリース	13,000	1,104.00	14,352,000
東京センチュリー	11,200	1,434.50	16,066,400
日本証券金融	5,400	1,588.00	8,575,200
アイフル	23,000	376.00	8,648,000
リコーリース	1,300	5,020.00	6,526,000
イオンフィナンシャルサービス	8,700	1,290.00	11,223,000
アコム	27,800	379.00	10,536,200
ジャックス	1,700	4,725.00	8,032,500
オリエントコーポレーション	4,700	1,014.00	4,765,800
オリックス	91,300	3,364.00	307,133,200
三菱HCキャピタル	67,800	1,018.00	69,020,400
日本取引所グループ	39,300	3,573.00	140,418,900

イー・ギャランティ	2,700	1,358.00	3,666,600
NECキャピタルソリューション	600	3,835.00	2,301,000
大東建託	5,600	16,435.00	92,036,000
サムティホールディングス	2,500	2,473.00	6,182,500
いちご	15,800	378.00	5,972,400
日本駐車場開発	19,800	198.00	3,920,400
スター・マイカ・ホールディングス	2,400	607.00	1,456,800
SREホールディングス	600	4,640.00	2,784,000
ヒューリック	35,300	1,447.00	51,079,100
野村不動産ホールディングス	8,400	3,940.00	33,096,000
三重交通グループホールディングス	3,700	589.00	2,179,300
ディア・ライフ	2,900	892.00	2,586,800
コーセーアールイー	300	720.00	216,000
地主	1,300	2,290.00	2,977,000
プレサンスコーポレーション	2,100	1,881.00	3,950,100
THEグローバル社	1,000	562.00	562,000
JPMC	1,200	1,200.00	1,440,000
サンセイランディック	300	1,007.00	302,100
エストラスト	300	707.00	212,100
フージャースホールディングス	2,500	1,143.00	2,857,500
オープンハウスグループ	5,600	4,717.00	26,415,200
東急不動産ホールディングス	45,500	1,051.00	47,820,500
飯田グループホールディングス	14,500	2,101.50	30,471,750
イーランド	100	1,543.00	154,300
ムゲンエステート	700	1,222.00	855,400
ビーロット	900	901.00	810,900
ファーストブラザーズ	200	1,185.00	237,000
And Doホールディングス	1,300	1,144.00	1,487,200
シーアールイー	900	1,452.00	1,306,800
ケイアイスター不動産	900	3,365.00	3,028,500
アグレ都市デザイン	300	1,567.00	470,100
グッドコムアセット	700	759.00	531,300
ジェイ・エス・ビー	900	2,929.00	2,636,100
ロードスターキャピタル	1,100	2,769.00	3,045,900
テンポイノベーション	500	873.00	436,500
グローバル・リンク・マネジメント	300	2,148.00	644,400
霞ヶ関キャピタル	600	14,020.00	8,412,000
パーク24	9,900	1,498.00	14,830,200
パラカ	700	2,012.00	1,408,400
ミガロホールディングス	200	4,960.00	992,000
三井不動産	211,200	1,416.00	299,059,200
三菱地所	99,500	2,480.00	246,760,000

平和不動産	2,400	3,895.00	9,348,000
東京建物	13,200	2,401.00	31,693,200
京阪神ビルディング	2,600	1,713.00	4,453,800
住友不動産	22,000	4,664.00	102,608,000
テオオーシー	2,500	681.00	1,702,500
レオパレス21	15,800	507.00	8,010,600
スターツコーポレーション	2,300	3,390.00	7,797,000
フジ住宅	1,900	738.00	1,402,200
空港施設	1,200	596.00	715,200
明和地所	1,500	920.00	1,380,000
ゴールドクレスト	1,100	2,624.00	2,886,400
エスリード	800	4,415.00	3,532,000
日神グループホールディングス	1,500	519.00	778,500
日本エスコン	3,300	1,043.00	3,441,900
MIRARTHホールディングス	6,700	489.00	3,276,300
イオンモール	7,800	1,946.00	15,178,800
毎日コムネット	400	741.00	296,400
カチタス	4,200	1,678.00	7,047,600
トーセイ	2,600	2,291.00	5,956,600
サンフロンティア不動産	2,400	1,920.00	4,608,000
FJネクストホールディングス	1,800	1,220.00	2,196,000
グランディハウス	600	588.00	352,800
日本空港ビルデング	5,300	5,404.00	28,641,200
明豊ファシリティワークス	700	880.00	616,000
MIXI	3,200	2,862.00	9,158,400
ジェイエイシーリクルートメント	6,000	645.00	3,870,000
日本M&Aセンターホールディングス	25,200	795.90	20,056,680
中広	100	486.00	48,600
UTグループ	2,100	2,839.00	5,961,900
アイティメディア	800	1,907.00	1,525,600
ケアネット	3,500	538.00	1,883,000
E・Jホールディングス	1,000	1,790.00	1,790,000
オープンアップグループ	4,800	1,946.00	9,340,800
コシダカホールディングス	5,000	851.00	4,255,000
アルトナー	400	1,907.00	762,800
パソナグループ	1,700	2,180.00	3,706,000
CDS	300	1,807.00	542,100
リンクアンドモチベーション	5,100	460.00	2,346,000
エス・エム・エス	5,600	2,043.00	11,440,800
サニーサイドアップグループ	300	656.00	196,800
パーソルホールディングス	160,600	210.30	33,774,180
アイ・ケイ・ケイホールディングス	700	785.00	549,500

学情	1,000	1,869.00	1,869,000
スタジオアリス	700	2,135.00	1,494,500
エプコ	200	818.00	163,600
N J S	300	3,900.00	1,170,000
総合警備保障	26,300	941.80	24,769,340
カカクコム	10,300	2,008.50	20,687,550
アイロムグループ	800	2,789.00	2,231,200
セントケア・ホールディング	1,600	827.00	1,323,200
ルネサンス	600	960.00	576,000
ディップ	2,500	2,614.00	6,535,000
デジタルホールディングス	500	1,043.00	521,500
新日本科学	1,600	1,354.00	2,166,400
キャリアデザインセンター	200	1,757.00	351,400
エムスリー	31,200	1,476.50	46,066,800
ツカダ・グローバルホールディング	700	462.00	323,400
ウェルネット	100	635.00	63,500
ワールドホールディングス	900	2,129.00	1,916,100
ディー・エヌ・エー	5,400	1,535.50	8,291,700
博報堂D Yホールディングス	20,000	1,094.00	21,880,000
ぐるなび	1,800	322.00	579,600
タカミヤ	1,700	487.00	827,900
ファンコミュニケーションズ	2,800	412.00	1,153,600
ライク	800	1,505.00	1,204,000
エスプール	5,900	314.00	1,852,600
W D Bホールディングス	1,000	1,841.00	1,841,000
ティア	500	459.00	229,500
アドウェイズ	1,700	388.00	659,600
バリューコマース	1,800	1,215.00	2,187,000
インフォマート	15,300	309.00	4,727,700
J Pホールディングス	4,600	540.00	2,484,000
プレステージ・インターナショナル	7,400	652.00	4,824,800
アミューズ	600	1,625.00	975,000
ドリームインキュベータ	700	2,177.00	1,523,900
クイック	1,200	2,095.00	2,514,000
電通グループ	15,600	3,916.00	61,089,600
ぴあ	600	3,040.00	1,824,000
イオンファンタジー	200	2,300.00	460,000
シーティーエス	2,400	790.00	1,896,000
H . U . グループホールディングス	4,600	2,492.00	11,463,200
アルプス技研	1,600	2,491.00	3,985,600
日本空調サービス	1,900	1,046.00	1,987,400
オリエンタルランド	84,100	4,385.00	368,778,500

ダスキン	3,400	3,679.00	12,508,600
明光ネットワークジャパン	2,400	736.00	1,766,400
ファルコホールディングス	600	2,295.00	1,377,000
ラウンドワン	15,100	793.00	11,974,300
リゾートトラスト	6,800	2,351.00	15,986,800
ビー・エム・エル	1,800	2,767.00	4,980,600
リソー教育	9,100	252.00	2,293,200
早稲田アカデミー	1,200	1,585.00	1,902,000
ユー・エス・エス	35,500	1,258.00	44,659,000
東京個別指導学院	3,000	408.00	1,224,000
サイバーエージェント	34,900	974.30	34,003,070
楽天グループ	136,200	786.00	107,053,200
クリーク・アンド・リバー社	1,100	1,756.00	1,931,600
SBIグローバルアセットマネジメント	3,500	647.00	2,264,500
テー・オー・ダブリュー	4,100	363.00	1,488,300
山田コンサルティンググループ	900	1,929.00	1,736,100
セントラルスポーツ	700	2,484.00	1,738,800
フルキャストホールディングス	1,700	1,500.00	2,550,000
エン・ジャパン	2,300	2,570.00	5,911,000
リソルホールディングス	100	4,720.00	472,000
テクノプロ・ホールディングス	9,300	2,570.00	23,901,000
アイ・アールジャパンホールディングス	1,000	1,230.00	1,230,000
Keeper 技研	1,000	4,070.00	4,070,000
ファーストロジック	300	516.00	154,800
三機サービス	100	1,112.00	111,200
Gunosy	700	773.00	541,100
イー・ガーディアン	900	1,932.00	1,738,800
リブセンス	900	217.00	195,300
ジャパンマテリアル	4,900	1,948.00	9,545,200
ベクトル	2,100	1,239.00	2,601,900
チャーム・ケア・コーポレーション	1,500	1,599.00	2,398,500
キャリアリンク	800	2,460.00	1,968,000
I B J	2,100	585.00	1,228,500
アサンテ	700	1,714.00	1,199,800
バリューHR	1,600	1,491.00	2,385,600
M&Aキャピタルパートナーズ	1,300	2,099.00	2,728,700
ライドオンエクスプレスホールディングス	500	1,034.00	517,000
E R Iホールディングス	300	2,271.00	681,300
シグマクシス・ホールディングス	2,300	1,518.00	3,491,400
ウィルグループ	1,700	948.00	1,611,600
メドピア	1,100	598.00	657,800
レアジョブ	300	425.00	127,500

リクルートホールディングス	114,500	7,885.00	902,832,500
エラン	2,400	894.00	2,145,600
日本郵政	166,100	1,475.00	244,997,500
ベルシステム24ホールディングス	1,800	1,438.00	2,588,400
鎌倉新書	2,200	445.00	979,000
一蔵	100	572.00	57,200
エアトリ	1,300	1,337.00	1,738,100
ストライク	800	4,215.00	3,372,000
ソラスト	4,900	452.00	2,214,800
セラク	900	1,167.00	1,050,300
インソース	3,700	891.00	3,296,700
ベイカレント・コンサルティング	11,600	3,121.00	36,203,600
Orchestra Holdings	100	1,462.00	146,200
アイモバイル	3,200	509.00	1,628,800
MS - Japan	900	1,047.00	942,300
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	5,200	2,424.00	12,604,800
グリーンズ	400	1,905.00	762,000
エル・ティー・エス	300	2,086.00	625,800
ミダックホールディングス	1,300	1,520.00	1,976,000
キュービーネットホールディングス	1,100	1,058.00	1,163,800
マネジメントソリューションズ	900	1,405.00	1,264,500
プロレド・パートナーズ	700	721.00	504,700
フロンティア・マネジメント	700	1,272.00	890,400
コプロ・ホールディングス	400	1,655.00	662,000
アンビスホールディングス	3,500	2,365.00	8,277,500
カーブスホールディングス	4,800	749.00	3,595,200
フォーラムエンジニアリング	2,400	832.00	1,996,800
Fast Fitness Japan	1,000	1,377.00	1,377,000
ポピンズ	100	1,204.00	120,400
LITALICO	1,300	1,802.00	2,342,600
コンフィデンス・インターワークス	100	1,838.00	183,800
アドバンテッジリスクマネジメント	200	503.00	100,600
リログループ	8,000	1,677.00	13,416,000
東祥	600	703.00	421,800
ID&Eホールディングス	800	4,250.00	3,400,000
ビーウィズ	600	1,829.00	1,097,400
TREホールディングス	2,700	1,174.00	3,169,800
人・夢・技術グループ	300	1,696.00	508,800
NISSOホールディングス	1,700	816.00	1,387,200
大栄環境	2,900	2,501.00	7,252,900
日本管財ホールディングス	1,700	2,599.00	4,418,300
M&A総研ホールディングス	1,700	3,325.00	5,652,500

エイチ・アイ・エス	4,400	1,685.00	7,414,000
ラックランド	300	2,094.00	628,200
共立メンテナンス	4,900	2,983.00	14,616,700
イチネンホールディングス	1,900	1,619.00	3,076,100
建設技術研究所	900	4,850.00	4,365,000
スペース	800	1,129.00	903,200
燦ホールディングス	1,700	1,153.00	1,960,100
スバル興業	600	2,531.00	1,518,600
ナガワ	400	7,760.00	3,104,000
東京都競馬	1,300	4,010.00	5,213,000
カナモト	2,200	2,982.00	6,560,400
ニシオホールディングス	1,200	4,055.00	4,866,000
トランス・コスモス	2,000	3,280.00	6,560,000
乃村工藝社	6,500	825.00	5,362,500
藤田観光	700	6,120.00	4,284,000
KNT-CTホールディングス	1,200	1,331.00	1,597,200
トーカイ	1,500	2,149.00	3,223,500
白洋舎	200	2,447.00	489,400
セコム	16,200	9,260.00	150,012,000
セントラル警備保障	900	2,949.00	2,654,100
丹青社	3,200	949.00	3,036,800
メイテックグループホールディングス	5,400	3,028.00	16,351,200
応用地質	1,300	2,627.00	3,415,100
船井総研ホールディングス	3,200	2,245.00	7,184,000
オオバ	700	1,070.00	749,000
学究社	800	2,077.00	1,661,600
イオンディライト	1,700	3,815.00	6,485,500
ナック	2,000	567.00	1,134,000
ダイセキ	3,300	3,280.00	10,824,000
ステップ	700	1,891.00	1,323,700
合 計	24,765,900		58,888,845,740

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引等に関する注記）」に記載しております。

海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2023年12月15日現在	2024年 6月17日現在
資産の部		
流動資産		
預金	349,821,192	2,287,799,228

	2023年12月15日現在	2024年 6月17日現在
コール・ローン	3,573,095,627	4,669,439,542
株式	317,161,514,512	412,973,561,923
投資証券	6,842,571,441	7,633,035,032
派生商品評価勘定	71,076,298	136,347,249
未収入金	2,775,016	5,687,657
未収配当金	354,905,771	445,848,034
未収利息	-	10,538
差入委託証拠金	571,985,363	697,047,301
流動資産合計	328,927,745,220	428,848,776,504
資産合計	328,927,745,220	428,848,776,504
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	117,681,005	12,091,535
未払金	10,744,272	2,119,499,366
未払解約金	128,736,772	115,627,728
未払利息	455	-
流動負債合計	257,162,504	2,247,218,629
負債合計	257,162,504	2,247,218,629
純資産の部		
元本等		
元本	61,539,821,052	63,890,308,192
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	267,130,761,664	362,711,249,683
元本等合計	328,670,582,716	426,601,557,875
純資産合計	328,670,582,716	426,601,557,875
負債純資産合計	328,927,745,220	428,848,776,504

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式及び投資証券は移動平均法に基づき、以下のとおり原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の日の最終相場）で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会等発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>(1) デリバティブ取引 個別法に基づき原則として時価で評価しております。</p> <p>(2) 為替予約取引 原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準 「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条及び第61条にしたがって処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	2023年12月15日現在	2024年 6月17日現在
1. 期首	2023年 6月16日	2023年12月16日
期首元本額	60,758,637,464円	61,539,821,052円
期首からの追加設定元本額	4,363,430,678円	5,907,299,398円
期首からの一部解約元本額	3,582,247,090円	3,556,812,258円
元本の内訳		
インデックスファンド海外株式ヘッジなし（DC専用）	33,478,093,158円	35,569,339,131円
DCインデックスバランス（株式20）	111,942,285円	97,765,501円
DCインデックスバランス（株式40）	314,447,783円	284,851,081円

	2023年12月15日現在	2024年 6月17日現在
DCインデックスバランス（株式60）	674,680,951円	640,667,893円
DCインデックスバランス（株式80）	813,952,034円	828,232,393円
世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	1,204,160,715円	1,013,764,879円
日興五大陸株式ファンド	3,382,512,685円	3,401,444,973円
インデックスファンド海外先進国株式（適格機関投資家向け）	13,022,622円	- 円
インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	73,757,018円	61,501,442円
インデックスファンド先進国株式（適格機関投資家向け）	5,867,931,474円	5,606,177,694円
グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	9,249,628,413円	7,427,646,928円
Tracers グローバル3分法（おとなのバランス）	8,994,188円	14,488,505円
インデックスファンドMSCIオール・カンントリー（全世界株式）	375,283,492円	3,052,926,149円
Tracers MSCIオール・カンントリー・インデックス（全世界株式）	333,240,519円	515,065,720円
Niつみインデックスラップ世界10指数（均等型）	314,126円	432,130円
Niつみインデックスラップ世界10指数（安定成長型）	140,694円	193,460円
国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	1,291,678,420円	1,059,413,705円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	15,330,884円	12,875,139円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	45,633,895円	40,127,956円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	72,579,204円	66,554,202円
年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	72,828,119円	68,168,612円
インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	4,139,668,373円	4,128,670,699円
計	61,539,821,052円	63,890,308,192円
2. 受益権の総数	61,539,821,052口	63,890,308,192口

当該親投資信託受益証券を投資対象とする投資信託ごとの元本額
（金融商品に関する注記）
金融商品の状況に関する事項

	自 2023年 6月16日 至 2023年12月15日	自 2023年12月16日 至 2024年 6月17日
金融商品に対する取組方針	当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品の運用を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドが運用する主な有価証券は、「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券等であり、全て売買目的で保有しております。また、主なデリバティブ取引には、先物取引、オプション取引、スワップ取引等があり、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行うことができます。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
金融商品に係るリスク管理体制	運用部門、営業部門と独立した組織であるリスク管理部門を設置し、全社的なリスク管理活動のモニタリング、指導の一元化を図っております。	同左

金融商品の時価等に関する事項

	2023年12月15日現在	2024年 6月17日現在
貸借対照表計上額、時価及びその差額	貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。 (2)デリバティブ取引 「デリバティブ取引等に関する注記」に記載しております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左

	2023年12月15日現在	2024年 6月17日現在
	(3)上記以外の金融商品 短期間で決済されることから、時価は帳簿価額と近似しているため、当該金融商品の時価を帳簿価額としております。	(3)上記以外の金融商品 同左
金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

(有価証券に関する注記)

(2023年12月15日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	33,018,272,506
投資証券	1,311,911,769
合計	34,330,184,275

(2024年 6月17日現在)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
株式	82,187,607,620
投資証券	1,159,952,150
合計	83,347,559,770

(注)当計算期間の損益に含まれた評価差額は、親投資信託の期首日から本書における開示対象ファンドの計算期間末日までに対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(株式関連)

(2023年12月15日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	4,579,056,186	-	4,648,059,834	69,003,648
合計		4,579,056,186	-	4,648,059,834	69,003,648

(2024年 6月17日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	6,250,261,782	-	6,319,481,048	69,219,266
合計		6,250,261,782	-	6,319,481,048	69,219,266

(注) 1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。
原則として本書における開示対象ファンドの計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、同計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

また契約額等及び時価の邦貨換算は、本書における開示対象ファンドの計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(通貨関連)

(2023年12月15日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	3,836,719,910	-	3,721,111,555	115,608,355
	米ドル	3,218,301,700	-	3,114,078,060	104,223,640
	ユーロ	618,418,210	-	607,033,495	11,384,715
合計		3,836,719,910	-	3,721,111,555	115,608,355

(2024年 6月17日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	5,359,601,749	-	5,414,637,207	55,035,458
	米ドル	4,312,122,720	-	4,362,460,480	50,337,760
	ユーロ	919,219,217	-	923,915,715	4,696,498
	英ポンド	66,942,380	-	66,946,634	4,254
	スイスフラン	41,202,275	-	41,202,158	117
	デンマーククローネ	20,115,157	-	20,112,220	2,937
	売建	11,087,725	-	11,086,735	990
	香港ドル	11,087,725	-	11,086,735	990
	合計		5,370,689,474	-	5,425,723,942

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 本書における開示対象ファンドの計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 同計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物売買相場の仲値をもとに計算しております。
- ・ 同計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

(2) 本書における開示対象ファンドの計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については同計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

(3) 上記の算定方法にて、適正な時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

2023年12月15日現在		2024年 6月17日現在	
1口当たり純資産額	5.3408円	1口当たり純資産額	6.6771円
(1万口当たり純資産額)	(53,408円)	(1万口当たり純資産額)	(66,771円)

附属明細表

第1 有価証券明細表
(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	APA CORP	18,890	27.82	525,519.80	
	BAKER HUGHES CO	40,615	31.09	1,262,720.35	
	CHENIERE ENERGY INC	9,880	155.88	1,540,094.40	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	4,720	85.14	401,860.80	
	CHEVRON CORP	76,331	152.57	11,645,820.67	
	CHORD ENERGY CORP	2,600	162.42	422,292.00	
	CONOCOPHILLIPS	50,966	109.39	5,575,170.74	
	COTERRA ENERGY INC	32,460	26.73	867,655.80	
	DEVON ENERGY CORPORATION	25,260	45.56	1,150,845.60	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	6,980	185.97	1,298,070.60	
	EOG RESOURCES INC	24,042	118.24	2,842,726.08	
	EQT CORP	17,050	39.34	670,747.00	
	EXXON MOBIL CORP	193,159	109.11	21,075,578.49	
	HALLIBURTON CO	37,607	32.92	1,238,022.44	
	HESS CORP	11,210	143.45	1,608,074.50	
	HF SINCLAIR CORP	5,940	52.23	310,246.20	
	KINDER MORGAN INC	81,490	19.59	1,596,389.10	
	MARATHON OIL CORP	28,380	27.30	774,774.00	
	MARATHON PETROLEUM CORP	15,742	170.07	2,677,241.94	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	28,351	59.84	1,696,523.84	
	ONEOK INC	24,500	78.10	1,913,450.00	
	OVINTIV INC	13,280	45.81	608,356.80	
	PHILLIPS 66	18,855	136.76	2,578,609.80	
	SCHLUMBERGER LTD	60,961	43.00	2,621,323.00	
	TARGA RESOURCES CORP	8,180	119.00	973,420.00	
	TEXAS PACIFIC LAND CORP	735	750.00	551,250.00	
	VALERO ENERGY CORP	14,682	150.07	2,203,327.74	
	WILLIAMS COS INC	50,624	41.17	2,084,190.08	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	9,115	275.14	2,507,901.10	
	ALBEMARLE CORP	4,750	103.51	491,672.50	
	AMCOR PLC	65,600	9.96	653,376.00	
	AVERY DENNISON CORP	3,040	226.53	688,651.20	
	BALL CORP	14,380	66.01	949,223.80	
	CELANESE CORP	4,090	139.39	570,105.10	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	7,820	73.26	572,893.20		
CLEVELAND-CLIFFS INC	21,150	14.91	315,346.50		
CORTEVA INC	29,832	51.18	1,526,801.76		
CRH PLC	29,300	76.55	2,242,915.00		

CROWN HOLDINGS INC	4,565	78.18	356,891.70
DOW INC	31,205	55.02	1,716,899.10
DUPONT DE NEMOURS INC	19,162	79.66	1,526,444.92
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	4,815	99.51	479,140.65
ECOLAB INC	11,060	240.05	2,654,953.00
FREEMONT-MCMORAN INC	61,328	48.11	2,950,490.08
INTERNATIONAL PAPER CO	13,670	44.89	613,646.30
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	10,675	94.54	1,009,214.50
LINDE PLC	20,710	436.95	9,049,234.50
LYONDELLBASELL INDU-CL A	10,570	93.54	988,717.80
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,720	566.85	1,541,832.00
MOSAIC CO/THE	13,580	27.16	368,832.80
NEWMONT CORP	49,002	40.82	2,000,261.64
NUCOR CORP	9,959	154.69	1,540,557.71
PACKAGING CORP OF AMERICA	3,580	182.68	653,994.40
PPG INDUSTRIES INC	10,334	127.32	1,315,724.88
RELIANCE INC	2,770	277.09	767,539.30
RPM INTERNATIONAL INC	4,960	111.29	551,998.40
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	10,316	296.99	3,063,748.84
STEEL DYNAMICS INC	7,090	120.69	855,692.10
VULCAN MATERIALS CO	5,563	252.64	1,405,436.32
WESTLAKE CORP	1,360	149.83	203,768.80
WESTROCK CO	9,989	49.66	496,053.74
3M CO	23,576	100.90	2,378,818.40
AECOM	7,170	86.59	620,850.30
AERCAP HOLDINGS NV	9,760	89.03	868,932.80
ALLEGION PLC	3,340	116.36	388,642.40
AMETEK INC	10,233	167.02	1,709,115.66
AXON ENTERPRISE INC	3,320	292.33	970,535.60
BOEING CO/THE	25,082	177.27	4,446,286.14
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	5,240	149.55	783,642.00
CARLISLE COS INC	2,250	405.30	911,925.00
CARRIER GLOBAL CORP	33,088	64.35	2,129,212.80
CATERPILLAR INC	21,826	321.47	7,016,404.22
CNH INDUSTRIAL NV	40,400	10.40	420,160.00
CUMMINS INC	6,355	266.48	1,693,480.40
DEERE & CO	11,455	378.00	4,329,990.00
DOVER CORP	6,680	177.25	1,184,030.00
EATON CORP PLC	17,276	319.02	5,511,389.52
EMCOR GROUP INC	2,010	377.20	758,172.00
EMERSON ELECTRIC CO	24,700	106.46	2,629,562.00
FASTENAL CO	24,326	63.05	1,533,754.30
FERGUSON PLC	8,440	201.47	1,700,406.80

FORTIVE CORP	14,854	72.73	1,080,331.42
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	5,050	67.33	340,016.50
GE VERNOVA INC	11,386	170.17	1,937,555.62
GENERAL DYNAMICS CORP	9,757	291.78	2,846,897.46
GENERAL ELECTRIC CO	47,177	155.88	7,353,950.76
GRACO INC	8,120	79.29	643,834.80
HEICO CORP	1,800	225.17	405,306.00
HEICO CORP-CLASS A	3,120	177.21	552,895.20
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	28,306	208.53	5,902,650.18
HOWMET AEROSPACE INC	17,943	78.94	1,416,420.42
HUBBELL INC	2,320	374.74	869,396.80
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	1,530	238.46	364,843.80
IDEX CORP	3,640	198.23	721,557.20
ILLINOIS TOOL WORKS	12,835	235.17	3,018,406.95
INGERSOLL-RAND INC	16,398	91.46	1,499,761.08
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	6,570	36.66	240,856.20
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	29,834	69.43	2,071,374.62
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	7,750	217.47	1,685,392.50
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,385	534.00	739,590.00
LOCKHEED MARTIN CORP	9,511	458.34	4,359,271.74
MASCO CORP	9,849	69.14	680,959.86
NORDSON CORP	2,345	228.72	536,348.40
NORTHROP GRUMMAN CORP	5,954	424.09	2,525,031.86
OTIS WORLDWIDE CORP	17,124	97.13	1,663,254.12
OWENS CORNING	3,550	176.58	626,859.00
PACCAR INC	21,896	106.72	2,336,741.12
PARKER HANNIFIN CORP	5,775	503.30	2,906,557.50
PENTAIR PLC	6,918	77.33	534,968.94
QUANTA SERVICES INC	6,700	273.29	1,831,043.00
ROCKWELL AUTOMATION INC	4,618	254.39	1,174,773.02
RTX CORP	58,166	104.23	6,062,642.18
SMITH (A.O.) CORP	5,020	82.46	413,949.20
SNAP-ON INC	2,525	262.24	662,156.00
STANLEY BLACK & DECKER INC	7,226	83.55	603,732.30
TEXTRON INC	7,956	85.25	678,249.00
TORO CO	3,890	96.61	375,812.90
TRANE TECHNOLOGIES PLC	9,666	329.64	3,186,300.24
TRANSDIGM GROUP INC	2,350	1,294.76	3,042,686.00
UNITED RENTALS INC	2,805	616.21	1,728,469.05
VERTIV HOLDINGS CO	17,190	91.48	1,572,541.20
WABTEC CORP	7,130	160.32	1,143,081.60
WATSCO INC	1,540	477.99	736,104.60
WW GRAINGER INC	1,847	906.79	1,674,841.13

XYLEM INC	10,898	138.02	1,504,141.96
AUTOMATIC DATA PROCESSING	17,771	242.62	4,311,600.02
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	5,910	150.42	888,982.20
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	5,230	195.13	1,020,529.90
CINTAS CORP	3,882	695.69	2,700,668.58
COPART INC	37,560	53.21	1,998,567.60
DAYFORCE INC	7,010	50.49	353,934.90
EQUIFAX INC	5,024	241.61	1,213,848.64
JACOBS SOLUTIONS INC	6,200	138.20	856,840.00
LEIDOS HOLDINGS INC	5,950	143.70	855,015.00
PAYCHEX INC	14,002	121.99	1,708,103.98
PAYCOM SOFTWARE INC	2,765	142.78	394,786.70
PAYLOCITY HOLDING CORP	1,730	139.23	240,867.90
REPUBLIC SERVICES INC	8,920	188.64	1,682,668.80
ROLLINS INC	14,385	48.50	697,672.50
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	8,470	60.69	514,044.30
TRANSUNION	7,940	71.79	570,012.60
VERALTO CORP	9,343	100.75	941,307.25
VERISK ANALYTICS INC	6,310	264.37	1,668,174.70
WASTE CONNECTIONS INC	10,606	168.61	1,788,277.66
WASTE MANAGEMENT INC	17,174	203.64	3,497,313.36
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	4,930	83.60	412,148.00
CSX CORP	84,959	32.18	2,733,980.62
DELTA AIR LINES INC	8,345	48.72	406,568.40
EXPEDITORS INTL WASH INC	6,467	123.39	797,963.13
FEDEX CORP	10,298	246.43	2,537,736.14
GRAB HOLDINGS LTD - CL A	77,000	3.60	277,200.00
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3,750	157.26	589,725.00
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	6,140	46.76	287,106.40
NORFOLK SOUTHERN CORP	9,745	219.90	2,142,925.50
OLD DOMINION FREIGHT LINE	8,450	172.74	1,459,653.00
SOUTHWEST AIRLINES CO	5,470	28.38	155,238.60
U-HAUL HOLDING CO	3,375	60.60	204,525.00
UBER TECHNOLOGIES INC	80,980	70.06	5,673,458.80
UNION PACIFIC CORP	26,336	222.10	5,849,225.60
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	31,497	135.65	4,272,568.05
APTIV PLC	12,290	70.30	863,987.00
FORD MOTOR COMPANY	177,905	11.71	2,083,267.55
GENERAL MOTORS CORP	52,355	46.77	2,448,643.35
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	39,110	10.88	425,516.80
TESLA INC	123,425	178.01	21,970,884.25
DECKERS OUTDOOR CORP	1,220	1,023.75	1,248,975.00
DR HORTON INC	12,896	142.78	1,841,290.88

GARMIN LTD	7,025	159.53	1,120,698.25
LENNAR CORP-CL A	10,040	155.10	1,557,204.00
LULULEMON ATHLETICA INC	4,710	306.01	1,441,307.10
NIKE INC -CL B	52,378	93.39	4,891,581.42
NVR INC	148	7,602.33	1,125,144.84
PULTE GROUP INC	8,850	114.09	1,009,696.50
AIRBNB INC-CLASS A	18,550	145.97	2,707,743.50
BOOKING HOLDINGS INC	1,483	3,859.10	5,723,045.30
CAESARS ENTERTAINMENT INC	7,970	36.03	287,159.10
CARNIVAL CORP	43,817	15.34	672,152.78
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,180	3,271.71	3,860,617.80
DARDEN RESTAURANTS INC	4,853	148.78	722,029.34
DOMINO'S PIZZA INC	1,375	521.41	716,938.75
DOORDASH INC - A	11,010	112.05	1,233,670.50
DRAFTKINGS INC-CL A	20,420	38.91	794,542.20
EXPEDIA GROUP INC	6,032	124.61	751,647.52
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	10,650	210.32	2,239,908.00
HYATT HOTELS CORP - CL A	1,680	147.47	247,749.60
LAS VEGAS SANDS CORP	16,310	43.25	705,407.50
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	10,673	239.45	2,555,649.85
MCDONALD'S CORP	31,101	253.58	7,886,591.58
MGM RESORTS INTERNATIONAL	12,900	39.85	514,065.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	9,948	148.50	1,477,278.00
STARBUCKS CORP	48,384	79.65	3,853,785.60
WYNN RESORTS LTD	4,180	88.80	371,184.00
YUM! BRANDS INC	11,394	136.79	1,558,585.26
ALPHABET INC-CL A	254,510	176.79	44,994,822.90
ALPHABET INC-CL C	219,630	178.37	39,175,403.10
CHARTER COMMUNICATION-A	3,926	276.26	1,084,596.76
COMCAST CORP-CLASS A	172,284	37.44	6,450,312.96
ELECTRONIC ARTS INC	10,834	135.98	1,473,207.32
FOX CORP - CLASS A	13,084	33.18	434,127.12
FOX CORP- CLASS B	5,466	30.94	169,118.04
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	15,096	29.42	444,124.32
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	10,280	72.43	744,580.40
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	6,420	88.75	569,775.00
MATCH GROUP INC	10,912	31.55	344,273.60
META PLATFORMS INC-CLASS A	94,530	504.16	47,658,244.80
NETFLIX INC	18,680	669.38	12,504,018.40
NEWS CORP - CLASS A	14,750	27.08	399,430.00
OMNICOM GROUP	9,397	88.41	830,788.77
PARAMOUNT GLOBAL	22,823	10.17	232,109.91
PINTEREST INC- CLASS A	27,330	43.51	1,189,128.30

ROBLOX CORP -CLASS A	19,130	35.10	671,463.00
ROKU INC	6,620	54.51	360,856.20
SEA LTD-ADR	16,470	74.42	1,225,697.40
SNAP INC - A	45,300	15.59	706,227.00
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	7,240	158.96	1,150,870.40
THE WALT DISNEY CO.	78,612	99.97	7,858,841.64
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	19,370	95.66	1,852,934.20
WARNER BROS DISCOVERY INC	94,890	7.24	687,003.60
AMAZON.COM INC	402,810	183.66	73,980,084.60
AUTOZONE INC	722	2,835.82	2,047,462.04
BATH & BODY WORKS INC	9,270	43.26	401,020.20
BEST BUY CO INC	7,814	87.21	681,458.94
BURLINGTON STORES INC	2,585	228.02	589,431.70
CARMAX INC	8,089	69.91	565,501.99
DICK'S SPORTING GOODS INC	2,270	216.28	490,955.60
EBAY INC	21,897	52.13	1,141,490.61
ETSY INC	4,800	58.87	282,576.00
GENUINE PARTS CO	5,751	136.70	786,161.70
GLOBAL-E ONLINE LTD	5,190	32.00	166,080.00
HOME DEPOT INC	42,705	346.84	14,811,802.20
LKQ CORP	10,260	40.29	413,375.40
LOWE'S COS INC	24,602	223.35	5,494,856.70
MERCADOLIBRE INC	1,960	1,582.14	3,100,994.40
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2,420	1,007.31	2,437,690.20
POOL CORP	1,540	341.31	525,617.40
ROSS STORES INC	13,762	145.93	2,008,288.66
TJX COMPANIES INC	48,976	108.50	5,313,896.00
TRACTOR SUPPLY COMPANY	4,530	280.25	1,269,532.50
ULTA BEAUTY INC	2,100	390.82	820,722.00
WILLIAMS-SONOMA INC	3,000	301.62	904,860.00
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	17,570	20.01	351,575.70
COSTCO WHOLESALE CORP	19,109	855.67	16,350,998.03
DOLLAR GENERAL CORP	9,855	125.79	1,239,660.45
DOLLAR TREE INC	8,986	106.03	952,785.58
KROGER CO	30,580	50.38	1,540,620.40
SYSCO CORP	20,636	70.69	1,458,758.84
TARGET CORP	19,870	141.16	2,804,849.20
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	30,782	15.55	478,660.10
WALMART INC	190,236	67.02	12,749,616.72
ALTRIA GROUP INC	76,018	44.32	3,369,117.76
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	22,143	59.50	1,317,508.50
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	10,590	43.66	462,359.40
BUNGE GLOBAL SA	5,847	102.83	601,247.01

CAMPBELL SOUP CO	7,885	43.99	346,861.15
CELSIUS HOLDINGS INC	6,050	59.96	362,758.00
COCA-COLA CO/THE	176,562	62.55	11,043,953.10
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	10,150	74.05	751,607.50
CONAGRA BRANDS INC	20,640	28.34	584,937.60
CONSTELLATION BRANDS INC-A	6,870	253.50	1,741,545.00
GENERAL MILLS INC	25,189	65.50	1,649,879.50
HERSHEY CO/THE	6,245	186.98	1,167,690.10
HORMEL FOODS CORP	15,290	30.48	466,039.20
JM SMUCKER CO/THE	4,100	111.58	457,478.00
KELLANOVA	11,098	57.52	638,356.96
KEURIG DR PEPPER INC	46,480	34.04	1,582,179.20
KRAFT HEINZ CO/THE	38,121	32.38	1,234,357.98
LAMB WESTON HOLDING INC	6,150	86.76	533,574.00
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	10,420	67.79	706,371.80
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	7,570	49.53	374,942.10
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	57,955	65.85	3,816,336.75
MONSTER BEVERAGE CORP	31,880	48.03	1,531,196.40
PEPSICO INC	59,261	163.81	9,707,544.41
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	67,028	102.20	6,850,261.60
TYSON FOODS INC-CL A	12,336	53.97	665,773.92
CHURCH & DWIGHT CO INC	10,310	107.70	1,110,387.00
CLOROX COMPANY	5,266	133.70	704,064.20
COLGATE-PALMOLIVE CO	33,160	94.62	3,137,599.20
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	10,080	113.90	1,148,112.00
KENVUE INC	89,200	18.07	1,611,844.00
KIMBERLY-CLARK CORP	14,753	139.49	2,057,895.97
PROCTER & GAMBLE CO	101,419	166.79	16,915,675.01
ABBOTT LABORATORIES	74,446	103.68	7,718,561.28
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,060	256.01	783,390.60
BAXTER INTERNATIONAL INC	23,599	33.78	797,174.22
BECTON DICKINSON AND CO	12,277	233.73	2,869,503.21
BOSTON SCIENTIFIC CORP	63,568	76.76	4,879,479.68
CARDINAL HEALTH INC	10,305	100.20	1,032,561.00
CENCORA INC	8,304	232.53	1,930,929.12
CENTENE CORP	22,367	68.93	1,541,757.31
CIGNA GROUP/THE	12,530	333.29	4,176,123.70
COOPER COS INC/THE	8,100	93.47	757,107.00
CVS HEALTH CORP	54,808	60.22	3,300,537.76
DAVITA INC	2,108	141.16	297,565.28
DEXCOM INC	16,520	115.95	1,915,494.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	26,110	87.29	2,279,141.90
ELEVANCE HEALTH INC	9,996	534.81	5,345,960.76

GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	19,125	76.49	1,462,871.25
HCA HEALTHCARE INC	8,190	337.47	2,763,879.30
HENRY SCHEIN INC	5,280	65.80	347,424.00
HOLOGIC INC	9,858	71.79	707,705.82
HUMANA INC	5,055	358.93	1,814,391.15
IDEXX LABORATORIES INC	3,360	504.00	1,693,440.00
INSULET CORP	2,745	200.45	550,235.25
INTUITIVE SURGICAL INC	15,315	425.78	6,520,820.70
LABCORP HOLDINGS INC	4,005	199.88	800,519.40
MCKESSON CORP	5,929	589.95	3,497,813.55
MEDTRONIC PLC	57,428	81.04	4,653,965.12
MOLINA HEALTHCARE INC	2,655	307.04	815,191.20
QUEST DIAGNOSTICS	5,276	137.85	727,296.60
RESMED INC	6,510	211.73	1,378,362.30
SOLVENTUM CORP	5,894	54.56	321,576.64
STERIS PLC	4,240	218.29	925,549.60
STRYKER CORP	14,793	344.98	5,103,289.14
TELEFLEX INC	1,820	208.29	379,087.80
UNITEDHEALTH GROUP INC	39,800	497.12	19,785,376.00
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	2,720	187.85	510,952.00
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS-A	6,870	184.70	1,268,889.00
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	8,412	107.19	901,682.28
ABBVIE INC	76,316	168.59	12,866,114.44
AGILENT TECHNOLOGIES INC	12,750	129.85	1,655,587.50
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	6,140	160.39	984,794.60
AMGEN INC	23,131	298.62	6,907,379.22
AVANTOR INC	27,110	21.68	587,744.80
BIO-RAD LABORATORIES-A	950	282.26	268,147.00
BIO-TECHNE CORP	6,730	75.87	510,605.10
BIOGEN INC	5,903	231.69	1,367,666.07
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	8,380	83.51	699,813.80
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	87,225	41.20	3,593,670.00
CATALENT INC	7,860	55.48	436,072.80
CHARLES RIVER LABORATORIES	2,420	209.47	506,917.40
DANAHER CORP	30,359	254.85	7,736,991.15
ELI LILLY & CO	34,789	878.45	30,560,397.05
EXACT SCIENCES CORP	7,370	41.88	308,655.60
GILEAD SCIENCES INC	54,044	65.06	3,516,102.64
ILLUMINA INC	6,855	108.66	744,864.30
INCYTE CORP	7,670	62.11	476,383.70
IQVIA HOLDINGS INC	7,438	212.75	1,582,434.50
JOHNSON & JOHNSON	103,821	145.54	15,110,108.34
MERCK & CO. INC.	109,133	129.48	14,130,540.84

METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	890	1,454.74	1,294,718.60
MODERNA INC	14,425	140.03	2,019,932.75
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	3,630	135.45	491,683.50
PFIZER INC	242,220	27.53	6,668,316.60
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,670	1,036.52	4,840,548.40
REPLIGEN CORP	2,250	125.62	282,645.00
REVVITY INC	4,910	108.65	533,471.50
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	18,800	26.92	506,096.00
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	49,020	17.16	841,183.20
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	16,504	572.05	9,441,113.20
UNITED THERAPEUTICS CORP	1,900	288.06	547,314.00
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	11,075	480.73	5,324,084.75
VIATRIS INC	53,899	10.17	548,152.83
WATERS CORP	2,661	294.94	784,835.34
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	3,550	333.25	1,183,037.50
ZOETIS INC	19,455	170.55	3,318,050.25
BANK OF AMERICA CORP	306,079	39.24	12,010,539.96
CITIGROUP INC	82,797	59.33	4,912,346.01
CITIZENS FINANCIAL GROUP	19,310	34.07	657,891.70
FIFTH THIRD BANCORP	29,319	35.22	1,032,615.18
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	450	1,631.83	734,323.50
HUNTINGTON BANCSHARES INC	68,620	12.37	848,829.40
JPMORGAN CHASE & CO	123,780	193.78	23,986,088.40
KEYCORP	36,108	13.36	482,402.88
M & T BANK CORP	6,913	142.18	982,890.34
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	17,950	151.09	2,712,065.50
REGIONS FINANCIAL CORP	40,884	18.65	762,486.60
TRUIST FINANCIAL CORP	55,680	35.41	1,971,628.80
US BANCORP	64,141	38.83	2,490,595.03
WELLS FARGO & CO	155,150	57.40	8,905,610.00
ALLY FINANCIAL INC	12,240	38.78	474,667.20
AMERICAN EXPRESS CO	24,794	224.82	5,574,187.08
AMERIPRISE FINANCIAL INC	4,225	423.86	1,790,808.50
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	16,940	115.87	1,962,837.80
ARES MANAGEMENT CORP-A	7,150	132.63	948,304.50
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	32,742	58.02	1,899,690.84
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	56,445	405.54	22,890,705.30
BLACKROCK INC	6,440	769.33	4,954,485.20
BLACKSTONE INC	30,570	121.25	3,706,612.50
BLOCK INC	23,390	62.15	1,453,688.50
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	17,385	133.70	2,324,374.50
CARLYLE GROUP INC/THE	7,650	39.05	298,732.50
CBOE GLOBAL MARKETS INC	4,570	167.60	765,932.00

CME GROUP INC	15,350	197.13	3,025,945.50
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	8,570	244.50	2,095,365.00
COREBRIDGE FINANCIAL INC	12,150	28.35	344,452.50
CORPAY INC	2,880	249.66	719,020.80
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	10,750	122.00	1,311,500.00
EQUITABLE HOLDINGS INC	14,420	39.68	572,185.60
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	1,590	401.74	638,766.60
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	24,198	76.57	1,852,840.86
FISERV INC	25,654	148.94	3,820,906.76
FRANKLIN RESOURCES INC	11,755	21.83	256,611.65
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	2,500	71.06	177,650.00
GLOBAL PAYMENTS INC	10,989	94.17	1,034,834.13
GOLDMAN SACHS GROUP INC	13,993	446.46	6,247,314.78
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	24,410	135.67	3,311,704.70
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,200	161.57	517,024.00
KKR & CO INC -A	27,920	109.18	3,048,305.60
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	3,185	277.17	882,786.45
MARKETAXESS HOLDINGS INC	1,545	200.22	309,339.90
MASTERCARD INC - A	35,870	444.63	15,948,878.10
MOODY'S CORP	7,072	408.12	2,886,224.64
MORGAN STANLEY	52,433	95.50	5,007,351.50
MSCI INC	3,175	480.53	1,525,682.75
NASDAQ INC	15,895	58.60	931,447.00
NORTHERN TRUST CORP	9,930	81.65	810,784.50
PAYPAL HOLDINGS INC	42,267	60.63	2,562,859.54
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	8,470	115.67	979,724.90
ROBINHOOD MARKETS INC - A	17,810	22.42	399,300.20
S&P GLOBAL INC	13,770	434.40	5,981,688.00
SCHWAB (CHARLES) CORP	65,193	73.25	4,775,387.25
SEI INVESTMENTS COMPANY	4,375	64.43	281,881.25
STATE STREET CORP	12,947	70.91	918,071.77
SYNCHRONY FINANCIAL	19,010	41.69	792,526.90
T ROWE PRICE GROUP INC	10,315	114.90	1,185,193.50
TOAST INC-CLASS A	18,170	22.72	412,822.40
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	4,200	104.31	438,102.00
VISA INC-CLASS A SHARES	68,142	270.66	18,443,313.72
AFLAC INC	23,424	87.04	2,038,824.96
ALLSTATE CORP	11,073	157.07	1,739,236.11
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	2,660	124.14	330,212.40
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	30,345	73.42	2,227,929.90
AON PLC	8,567	295.39	2,530,606.13
ARCH CAPITAL GROUP LTD	16,205	97.26	1,576,098.30
ARTHUR J GALLAGHER & CO	8,970	258.24	2,316,412.80

ASSURANT INC	2,470	165.54	408,883.80
BROWN & BROWN INC	10,940	90.08	985,475.20
CHUBB LTD	17,375	259.46	4,508,117.50
CINCINNATI FINANCIAL CORP	7,350	112.27	825,184.50
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	1,090	349.82	381,303.80
EVEREST GROUP LTD	1,989	367.56	731,076.84
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	11,071	48.28	534,507.88
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	12,382	99.47	1,231,637.54
LOEWS CORP	9,765	73.79	720,559.35
MARKEL GROUP INC	530	1,544.07	818,357.10
MARSH & MCLENNAN COS	21,118	208.88	4,411,127.84
METLIFE INC	26,335	68.55	1,805,264.25
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	9,520	76.66	729,803.20
PROGRESSIVE CORP	25,310	203.92	5,161,215.20
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	14,962	113.11	1,692,351.82
TRAVELERS COS INC/THE	10,189	205.85	2,097,405.65
WILLIS TOWERS WATSON PLC	4,198	255.28	1,071,665.44
WR BERKLEY CORP	8,091	78.15	632,311.65
ACCENTURE PLC-CL A	27,133	286.71	7,779,302.43
ADOBE INC	19,299	525.31	10,137,957.69
AKAMAII TECHNOLOGIES INC	6,030	89.09	537,212.70
ANSYS INC	3,515	323.17	1,135,942.55
APPROVIN CORP-CLASS A	7,930	77.52	614,733.60
ASPEN TECHNOLOGY INC	1,300	197.66	256,958.00
ATLASSIAN CORP PLC-CLASS A	6,850	160.09	1,096,616.50
AUTODESK INC	8,720	225.87	1,969,586.40
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	9,480	50.19	475,801.20
CADENCE DESIGN SYS INC	11,820	312.10	3,689,022.00
CHECK POINT SOFTWARE TECH	3,840	156.49	600,921.60
CLOUDFLARE INC-CLASS A	13,050	75.59	986,449.50
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	21,758	64.26	1,398,169.08
CONFLUENT INC-CLASS A	6,870	27.77	190,779.90
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	9,810	385.43	3,781,117.35
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,650	252.33	416,344.50
DATADOG INC-CLASS A	10,880	117.84	1,282,099.20
DOCUSIGN INC	8,320	50.84	422,988.80
DYNATRACE INC	12,980	45.91	595,911.80
EPAM SYSTEMS INC	2,500	177.58	443,950.00
FAIR ISAAC CORP	1,120	1,390.59	1,557,460.80
FORTINET INC	28,035	60.78	1,703,967.30
GARTNER INC	3,490	432.21	1,508,412.90
GEN DIGITAL INC	24,365	24.39	594,262.35
GODADDY INC-CLASS A	6,020	137.53	827,930.60

HUBSPOT INC	1,885	584.71	1,102,178.35
INTL BUSINESS MACHINES CORP	39,582	169.21	6,697,670.22
INTUIT INC	12,086	595.70	7,199,630.20
MANHATTAN ASSOCIATES INC	3,220	228.84	736,864.80
MICROSOFT CORP	303,654	442.57	134,388,150.78
MICROSTRATEGY INC-CL A	670	1,495.54	1,002,011.80
MONDAY.COM LTD	1,970	226.58	446,362.60
MONGODB INC	2,990	227.00	678,730.00
OKTA INC	7,610	89.76	683,073.60
ORACLE CORP	71,153	138.13	9,828,363.89
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	80,660	23.57	1,901,156.20
PALO ALTO NETWORKS INC	13,985	317.31	4,437,580.35
PTC INC	5,250	173.50	910,875.00
ROPER TECHNOLOGIES INC	4,460	549.45	2,450,547.00
SALESFORCE INC	41,826	231.94	9,701,122.44
SAMSARA INC-CL A	8,370	28.07	234,945.90
SERVICENOW INC	8,855	728.58	6,451,575.90
SNOWFLAKE INC-CLASS A	13,900	127.17	1,767,663.00
SYNOPSYS INC	6,607	590.21	3,899,517.47
TWILIO INC - A	7,225	54.24	391,884.00
TYLER TECHNOLOGIES INC	1,830	471.79	863,375.70
UIPATH INC - CLASS A	17,970	11.54	207,373.80
UNITY SOFTWARE INC	9,650	16.40	158,260.00
VERISIGN INC	4,530	180.31	816,804.30
WIX.COM LTD	2,280	163.61	373,030.80
WORKDAY INC-CLASS A	8,580	209.48	1,797,338.40
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	12,150	57.74	701,541.00
ZSCALER INC	3,630	184.22	668,718.60
AMPHENOL CORP-CL A	52,140	68.27	3,559,597.80
APPLE INC	631,054	212.49	134,092,664.46
ARISTA NETWORKS INC	11,520	328.50	3,784,320.00
CDW CORP/DE	5,895	223.19	1,315,705.05
CISCO SYSTEMS INC	174,210	45.68	7,957,912.80
CORNING INC	33,518	37.25	1,248,545.50
DELL TECHNOLOGIES -C	11,022	134.98	1,487,749.56
F5 INC	2,385	167.58	399,678.30
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	50,105	21.60	1,082,268.00
HP INC	40,345	35.51	1,432,650.95
JABIL INC	5,590	119.48	667,893.20
JUNIPER NETWORKS INC	13,453	35.46	477,043.38
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	7,160	135.98	973,616.80
MOTOROLA SOLUTIONS INC	6,880	375.41	2,582,820.80
NETAPP INC	8,246	126.17	1,040,397.82

PURE STORAGE INC - CLASS A	13,200	67.68	893,376.00
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	9,754	103.86	1,013,050.44
SUPER MICRO COMPUTER INC	2,140	844.54	1,807,315.60
TE CONNECTIVITY LTD	12,995	147.35	1,914,813.25
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	2,020	389.60	786,992.00
TRIMBLE INC	11,410	54.81	625,382.10
WESTERN DIGITAL CORP	14,028	78.12	1,095,867.36
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	2,075	301.37	625,342.75
AT&T INC	309,067	17.64	5,451,941.88
T-MOBILE US INC	23,119	175.99	4,068,712.81
VERIZON COMMUNICATIONS INC	181,457	39.67	7,198,399.19
AES CORP	27,958	19.34	540,707.72
ALLIANT ENERGY CORP	12,150	49.84	605,556.00
AMEREN CORPORATION	12,892	70.12	903,987.04
AMERICAN ELECTRIC POWER	22,348	88.00	1,966,624.00
AMERICAN WATER WORKS CO INC	7,705	129.30	996,256.50
ATMOS ENERGY CORP	6,760	116.15	785,174.00
CENTERPOINT ENERGY INC	31,272	30.85	964,741.20
CMS ENERGY CORP	11,090	59.65	661,518.50
CONSOLIDATED EDISON INC	14,236	90.87	1,293,625.32
CONSTELLATION ENERGY	13,168	214.90	2,829,803.20
DOMINION ENERGY INC	36,341	50.43	1,832,676.63
DTE ENERGY COMPANY	8,318	112.14	932,780.52
DUKE ENERGY CORP	33,076	102.36	3,385,659.36
EDISON INTERNATIONAL	16,329	73.21	1,195,446.09
ENTERGY CORP	9,247	107.02	989,613.94
ESSENTIAL UTILITIES INC	11,210	37.13	416,227.30
EVERGY INC	8,720	52.74	459,892.80
EVERSOURCE ENERGY	14,310	59.01	844,433.10
EXELON CORP	43,056	35.54	1,530,210.24
FIRSTENERGY CORP	23,295	38.77	903,147.15
NEXTERA ENERGY INC	88,600	73.06	6,473,116.00
NISOURCE INC	23,010	28.17	648,191.70
NRG ENERGY INC	9,770	78.64	768,312.80
P G & E CORP	85,070	18.25	1,552,527.50
PPL CORP	30,338	28.08	851,891.04
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	22,058	72.64	1,602,293.12
SEMPRA	27,094	75.97	2,058,331.18
SOUTHERN CO	46,765	78.65	3,678,067.25
VISTRA CORP	14,720	87.59	1,289,324.80
WEC ENERGY GROUP INC	14,270	78.86	1,125,332.20
XCEL ENERGY INC	22,174	53.77	1,192,295.98
ADVANCED MICRO DEVICES	69,664	159.63	11,120,464.32

	ANALOG DEVICES INC	21,327	231.19	4,930,589.13
	APPLIED MATERIALS INC	35,633	237.03	8,446,089.99
	BROADCOM INC	18,940	1,735.04	32,861,657.60
	ENPHASE ENERGY INC	6,430	124.61	801,242.30
	ENTEGRIS INC	6,650	133.90	890,435.00
	FIRST SOLAR INC	4,260	273.61	1,165,578.60
	INTEL CORP	183,932	30.45	5,600,729.40
	KLA CORP	5,789	824.84	4,774,998.76
	LAM RESEARCH CORP	5,622	1,035.98	5,824,279.56
	LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	6,540	60.22	393,838.80
	MARVELL TECHNOLOGY INC	36,844	73.27	2,699,559.88
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	23,418	91.35	2,139,234.30
	MICRON TECHNOLOGY INC	47,387	141.36	6,698,626.32
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	2,070	806.57	1,669,599.90
	NVIDIA CORP	1,075,440	131.88	141,829,027.20
	NXP SEMICONDUCTORS NV	10,887	268.85	2,926,969.95
	ON SEMICONDUCTOR CORP	18,380	71.97	1,322,808.60
	QORVO INC	4,240	112.38	476,491.20
	QUALCOMM INC	47,912	215.33	10,316,890.96
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	6,440	104.37	672,142.80
	TERADYNE INC	6,190	145.06	897,921.40
	TEXAS INSTRUMENTS INC	39,272	193.90	7,614,840.80
	CBRE GROUP INC - A	12,560	86.90	1,091,464.00
	COSTAR GROUP INC	16,800	73.93	1,242,024.00
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	40,500	3.22	130,410.00
	ZILLOW GROUP INC - C	6,370	48.00	305,760.00
	米ドル小計	15,605,177		2,005,641,329.87 (315,948,678,694)
加ドル	ARC RESOURCES LTD	25,510	23.95	610,964.50
	CAMECO CORP	19,282	71.29	1,374,613.78
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	91,808	46.62	4,280,088.96
	CENOVUS ENERGY INC	57,213	25.06	1,433,757.78
	ENBRIDGE INC	91,207	48.25	4,400,737.75
	IMPERIAL OIL LTD	8,922	88.11	786,117.42
	KEYERA CORP	8,460	36.59	309,551.40
	MEG ENERGY CORP	11,500	27.71	318,665.00
	PARKLAND CORP	6,170	38.71	238,840.70
	PEMBINA PIPELINE CORP	23,552	50.92	1,199,267.84
	SUNCOR ENERGY INC	53,489	50.26	2,688,357.14
	TC ENERGY CORP	45,033	53.25	2,398,007.25
	TOURMALINE OIL CORP	15,980	63.13	1,008,817.40
	AGNICO EAGLE MINES LTD	21,496	88.27	1,897,451.92
	BARRICK GOLD CORP	69,624	22.01	1,532,424.24

CCL INDUSTRIES INC - CL B	5,750	72.68	417,910.00
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	22,650	16.49	373,498.50
FRANCO-NEVADA CORP	8,125	159.49	1,295,856.25
IVANHOE MINES LTD-CL A	24,510	17.48	428,434.80
KINROSS GOLD CORP	55,925	10.19	569,875.75
LUNDIN MINING CORP	25,010	14.70	367,647.00
NUTRIEN LTD	20,908	70.32	1,470,250.56
PAN AMERICAN SILVER CORP	16,410	27.31	448,157.10
TECK RESOURCES LTD-CLS B	21,725	65.61	1,425,377.25
WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,450	109.73	268,838.50
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	19,165	72.70	1,393,295.50
CAE INC	12,305	24.77	304,794.85
STANTEC INC	5,720	113.27	647,904.40
TOROMONT INDUSTRIES LTD	3,260	117.56	383,245.60
WSP GLOBAL INC	5,800	206.84	1,199,672.00
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	13,800	24.21	334,098.00
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	11,710	52.12	610,325.20
RB GLOBAL INC	7,560	109.75	829,710.00
THOMSON REUTERS CORP	7,350	229.65	1,687,927.50
AIR CANADA	7,190	17.16	123,380.40
CANADIAN NATL RAILWAY CO	23,418	167.29	3,917,597.22
CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY	39,281	105.62	4,148,859.22
TFI INTERNATIONAL INC	3,210	188.90	606,369.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	10,668	57.97	618,423.96
BRP INC/CA- SUB VOTING	1,570	84.73	133,026.10
GILDAN ACTIVEWEAR INC	7,040	51.62	363,404.80
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	12,858	94.65	1,217,009.70
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	2,250	135.15	304,087.50
DOLLARAMA INC	12,990	123.85	1,608,811.50
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	32,350	75.90	2,455,365.00
EMPIRE CO LTD 'A'	6,950	32.11	223,164.50
LOBLAW COMPANIES LTD	6,339	156.35	991,102.65
METRO INC	9,570	73.99	708,084.30
WESTON (GEORGE) LTD	2,808	189.32	531,610.56
SAPUTO INC	9,620	29.37	282,539.40
BANK OF MONTREAL	30,681	114.86	3,524,019.66
BANK OF NOVA SCOTIA	52,339	63.70	3,333,994.30
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	42,300	65.31	2,762,613.00
NATIONAL BANK OF CANADA	13,750	106.43	1,463,412.50
ROYAL BANK OF CANADA	60,139	142.87	8,592,058.93
TORONTO-DOMINION BANK	76,520	74.53	5,703,035.60
BROOKFIELD ASSET MGMT-A	13,859	52.22	723,716.98
BROOKFIELD CORP	57,209	56.24	3,217,434.16

	IGM FINANCIAL INC	3,335	36.88	122,994.80	
	ONEX CORPORATION	2,765	94.31	260,767.15	
	TMX GROUP LTD	10,850	37.14	402,969.00	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	900	1,526.56	1,373,904.00	
	GREAT-WEST LIFECO INC	11,324	39.21	444,014.04	
	IA FINANCIAL CORP INC	4,075	85.18	347,108.50	
	INTACT FINANCIAL CORP	7,215	222.40	1,604,616.00	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	76,211	34.50	2,629,279.50	
	POWER CORP OF CANADA	27,929	38.45	1,073,870.05	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	24,774	65.34	1,618,733.16	
	CGI INC	9,510	136.86	1,301,538.60	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	870	3,800.00	3,306,000.00	
	DESCARTES SYSTEMS GRP/THE	3,740	129.20	483,208.00	
	OPEN TEXT CORP	11,190	39.51	442,116.90	
	SHOPIFY INC - CLASS-A	50,580	92.94	4,700,905.20	
	BCE INC	3,000	45.18	135,540.00	
	QUEBECOR INC -CL B	6,110	29.12	177,923.20	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	16,655	51.93	864,894.15	
	TELUS CORP	12,662	21.72	275,018.64	
	ALTAGAS LTD	11,170	30.47	340,349.90	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	5,445	41.30	224,878.50	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	4,560	30.46	138,897.60	
	EMERA INC	10,460	45.81	479,172.60	
	FORTIS INC	22,635	53.69	1,215,273.15	
	HYDRO ONE LTD	13,230	39.42	521,526.60	
	NORTHLAND POWER INC	8,600	23.88	205,368.00	
	FIRSTSERVICE CORP	1,500	209.38	314,070.00	
加ドル小計		1,735,583		111,492,540.02 (12,787,079,414)	
ユーロ	ENI SPA	100,696	13.50	1,360,201.56	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	18,755	18.72	351,187.37	
	NESTE OYJ	18,710	17.79	332,850.90	
	OMV AG	5,480	39.06	214,048.80	
	REPSOL SA	54,849	14.30	784,614.94	
	TENARIS SA	23,455	14.31	335,758.32	
	TOTALENERGIES SE	92,297	61.42	5,668,881.74	
	AIR LIQUIDE SA	24,704	159.28	3,934,853.12	
	AKZO NOBEL	6,937	58.10	403,039.70	
	ARCELORMITTAL	20,552	21.82	448,444.64	
	ARKEMA	2,215	83.70	185,395.50	
	BASF SE	37,045	44.58	1,651,651.32	
	COVESTRO AG	7,410	50.24	372,278.40	
	DSM-FIRMENICH AG	7,552	99.24	749,460.48	

EVONIK INDUSTRIES AG	16,230	18.24	296,035.20
HEIDELBERG MATERIALS AG	5,715	95.26	544,410.90
OCI NV	4,810	23.23	111,736.30
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	13,250	42.14	558,355.00
STORA ENSO OYJ-R SHS	25,365	12.38	314,145.52
SYENSQO SA	2,811	88.33	248,295.63
SYMRISE AG	5,790	112.40	650,796.00
UMICORE	7,960	13.63	108,494.80
UPM-KYMMENE OYJ	25,098	32.69	820,453.62
VOESTALPINE AG	4,249	24.62	104,610.38
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	7,876	39.22	308,896.72
AIRBUS GROUP SE	25,708	143.82	3,697,324.56
ALSTOM	11,635	15.50	180,400.67
ALSTOM SA - RTS	11,635	1.06	12,333.10
BOUYGUES SA	8,460	30.80	260,568.00
BRENTAG SE	6,865	65.00	446,225.00
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	19,106	72.30	1,381,363.80
DAIMLER TRUCK HOLDING AG	23,136	36.47	843,769.92
DASSAULT AVIATION SA	900	174.20	156,780.00
EIFFAGE	3,250	84.96	276,120.00
FERROVIAL SE	24,155	36.62	884,556.10
GEA GROUP AG	6,020	37.66	226,713.20
IMCD NV	2,120	136.55	289,486.00
KINGSPAN GROUP PLC	7,300	81.05	591,665.00
KNORR-BREMSE AG	2,970	70.40	209,088.00
KONE OYJ-B	13,614	47.24	643,125.36
LEGRAND SA	11,128	93.46	1,040,022.88
LEONARDO SPA	16,300	21.18	345,234.00
METSO CORPORATION	24,200	10.40	251,680.00
MTU AERO ENGINES AG	2,540	224.40	569,976.00
PRYSMIAN SPA	12,035	56.64	681,662.40
RATIONAL AG	230	792.50	182,275.00
REXEL SA	11,150	24.60	274,290.00
RHEINMETALL AG	2,090	479.20	1,001,528.00
SAFRAN SA	14,810	196.65	2,912,386.50
SCHNEIDER ELECTRIC SE	23,508	221.20	5,199,969.60
SIEMENS AG-REG	32,826	165.74	5,440,581.24
SIEMENS ENERGY AG	21,343	23.24	496,011.32
THALES SA	4,925	150.30	740,227.50
VINCI SA	20,600	98.14	2,021,684.00
WARTSILA OYJ ABP	18,180	18.96	344,783.70
BUREAU VERITAS SA	16,910	26.66	450,820.60
RANDSTAD NV	4,675	45.42	212,338.50

TELEPERFORMANCE	2,240	93.30	208,992.00
WOLTERS KLUWER	10,027	152.70	1,531,122.90
ADP	1,630	112.80	183,864.00
AENA SA	3,750	184.60	692,250.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	23,880	5.89	140,796.48
DEUTSCHE POST AG-REG	39,823	37.75	1,503,318.25
GETLINK	17,310	15.53	268,910.85
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	13,355	86.90	1,160,549.50
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	3,150	81.40	256,410.00
CONTINENTAL AG	4,385	55.00	241,175.00
DR ING HC F PORSCHE AG-PRF	4,380	70.62	309,315.60
FERRARI NV	5,459	379.70	2,072,782.30
MERCEDES-BENZ GROUP AG	34,202	63.20	2,161,566.40
MICHELIN (CGDE)	30,986	36.90	1,143,383.40
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	5,670	42.46	240,748.20
RENAULT SA	8,247	48.14	397,010.58
STELLANTIS NV	90,796	18.82	1,708,780.72
VOLKSWAGEN AG	1,151	112.40	129,372.40
VOLKSWAGEN AG-PFD	9,083	104.50	949,173.50
ADIDAS AG	6,571	224.90	1,477,817.90
HERMES INTERNATIONAL	1,342	2,112.00	2,834,304.00
KERING	3,007	302.50	909,617.50
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	11,894	711.40	8,461,391.60
MONCLER SPA	10,320	58.64	605,164.80
PUMA SE	4,200	45.06	189,252.00
SEB SA	987	102.80	101,463.60
ACCOR SA	10,106	37.03	374,225.18
AMADEUS IT GROUP SA	21,100	64.20	1,354,620.00
DELIVERY HERO SE	6,600	27.84	183,744.00
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	3,900	31.00	120,900.00
SODEXO SA	3,240	84.00	272,160.00
BOLLORE SE	33,530	5.74	192,462.20
CTS EVENTIM AG & CO KGAA	2,660	79.30	210,938.00
PUBLICIS GROUPE	9,305	97.76	909,656.80
SCOUT24 SE	2,970	70.40	209,088.00
UNIVERSAL MUSIC GROUP BV	36,410	28.63	1,042,418.30
VIVENDI SE	26,070	9.50	247,665.00
D'IETEREN GROUP	1,050	190.00	199,500.00
INDITEX	45,895	45.96	2,109,334.20
PROSUS NV	62,794	33.91	2,129,658.51
ZALANDO SE	8,260	22.15	182,959.00
CARREFOUR SA	22,633	14.40	326,028.36
JERONIMO MARTINS	10,585	19.62	207,677.70

KESKO OYJ-B SHS	10,930	16.44	179,743.85
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	40,028	28.08	1,123,986.24
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	36,121	55.46	2,003,270.66
DANONE	25,794	58.80	1,516,687.20
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	30,650	9.62	294,853.00
HEINEKEN HOLDING NV	4,895	76.55	374,712.25
HEINEKEN NV	12,733	94.84	1,207,597.72
JDE PEET'S NV	6,290	19.57	123,095.30
KERRY GROUP PLC-A	6,460	75.30	486,438.00
LOTUS BAKERIES	20	9,990.00	199,800.00
PERNOD-RICARD SA	8,296	131.90	1,094,242.40
REMY COINTREAU	810	80.10	64,881.00
BEIERSDORF AG	4,375	146.45	640,718.75
HENKEL AG & CO KGAA	4,520	73.65	332,898.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	6,793	83.06	564,226.58
L'OREAL	10,296	440.45	4,534,873.20
AMPLIFON SPA	4,830	34.64	167,311.20
BIOMERIEUX	1,690	90.80	153,452.00
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	1,610	84.35	135,803.50
DIASORIN ITALIA SPA	930	97.98	91,121.40
ESSILORLUXOTTICA	12,675	201.00	2,547,675.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG	9,583	38.63	370,191.29
FRESENIUS SE & CO KGAA	20,905	29.56	617,951.80
KONINKLIJKE PHILIPS NV	38,028	24.11	916,855.08
SIEMENS HEALTHINEERS AG	13,430	53.64	720,385.20
ARGENX SE	2,495	360.90	900,445.50
BAYER AG-REG	43,824	27.06	1,186,096.56
EUROFINS SCIENTIFIC	5,050	52.12	263,206.00
IPSEN	1,600	120.50	192,800.00
MERCK KGAA	5,940	172.00	1,021,680.00
ORION OYJ-CLASS B	4,500	37.58	169,110.00
QIAGEN N.V.	10,072	39.70	399,858.40
RECORDATI SPA	3,720	48.10	178,932.00
SANOFI	49,226	86.43	4,254,603.18
SARTORIUS AG-VORZUG-PRF	1,230	245.70	302,211.00
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	1,080	178.75	193,050.00
UCB SA	5,398	137.85	744,114.30
ABN AMRO BANK NV-CVA	23,550	15.24	359,019.75
AIB GROUP PLC	70,100	4.78	335,498.60
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	241,763	9.02	2,180,702.26
BANCO BPM SPA	49,000	5.88	288,120.00
BANCO DE SABADELL SA	232,000	1.74	404,144.00
BANCO SANTANDER SA	694,189	4.37	3,039,506.53

BANK OF IRELAND GROUP PLC	44,790	9.72	435,358.80
BNP PARIBAS	44,242	58.41	2,584,175.22
CAIXABANK S.A	163,050	4.87	794,868.75
COMMERZBANK AG	40,474	13.76	557,124.61
CREDIT AGRICOLE SA	49,662	13.03	647,344.17
ERSTE GROUP BANK AG	15,328	42.02	644,082.56
FINECOBANK SPA	23,540	13.98	329,206.90
ING GROEP NV-CVA	146,925	15.33	2,252,654.10
INTESA SANPAOLO	621,793	3.33	2,070,570.69
KBC GROEP NV	11,219	64.16	719,811.04
MEDIOBANCA SPA	19,520	13.52	264,008.00
NORDEA BANK ABP	131,132	11.30	1,481,791.60
SOCIETE GENERALE	30,909	22.15	684,634.35
UNICREDIT SPA	64,276	32.53	2,091,219.66
ADYEN NV	935	1,197.60	1,119,756.00
AMUNDI SA	2,140	60.25	128,935.00
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	80,935	14.41	1,166,597.09
DEUTSCHE BOERSE AG	8,250	182.25	1,503,562.50
EDENRED	9,626	40.54	390,238.04
EURAZEO SE	1,487	71.95	106,989.65
EURONEXT NV	3,470	89.30	309,871.00
EXOR NV	4,164	96.85	403,283.40
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	3,452	66.75	230,421.00
NEXI SPA	21,240	5.65	120,175.92
SOFINA	655	215.40	141,087.00
AEGON LTD	69,679	5.67	395,637.36
AGEAS	5,924	42.20	249,992.80
ALLIANZ SE-REG	16,933	253.40	4,290,822.20
ASR NEDERLAND NV	5,880	43.55	256,074.00
ASSICURAZIONI GENERALI	42,248	22.59	954,382.32
AXA SA	75,752	29.43	2,229,381.36
HANNOVER RUECK SE-REG	2,775	226.60	628,815.00
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	5,626	456.80	2,569,956.80
NN GROUP NV	10,270	41.34	424,561.80
POSTE ITALIANE SPA	19,560	12.17	238,143.00
SAMPO OYJ-A SHS	19,639	39.29	771,616.31
TALANX AG	2,500	71.60	179,000.00
BECHTLE AG	3,070	44.46	136,492.20
CAP GEMINI SA	6,509	182.30	1,186,590.70
DASSAULT SYSTEMES SE	27,400	35.71	978,454.00
NEMETSCHKE SE	2,350	90.70	213,145.00
SAP SE	45,052	174.78	7,874,188.56
NOKIA OYJ	251,336	3.38	851,275.03

CELLNEX TELECOM SA	24,690	32.39	799,709.10	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	138,256	22.63	3,128,733.28	
ELISA OYJ	6,005	42.62	255,933.10	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	15,170	9.78	148,362.60	
KONINKLIJKE KPN NV	204,956	3.49	716,526.17	
ORANGE S.A.	83,604	9.29	776,848.36	
TELECOM ITALIA SPA	400,513	0.22	89,634.80	
TELEFONICA SA	195,629	4.11	804,035.19	
ACCIONA SA	830	115.60	95,948.00	
E.ON SE	90,999	12.43	1,131,117.57	
EDP RENOVAVEIS SA	11,333	13.76	155,942.08	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	126,131	3.67	463,026.90	
ELIA GROUP SA/NV	1,356	90.30	122,446.80	
ENDESA SA	12,050	18.62	224,371.00	
ENEL SPA	344,237	6.33	2,181,429.86	
ENGIE	82,214	13.27	1,090,979.78	
FORTUM OYJ	16,755	14.20	237,921.00	
IBERDROLA SA	263,272	12.12	3,192,173.00	
REDEIA CORP SA	20,650	17.06	352,289.00	
RWE AG	25,835	33.16	856,688.60	
SNAM SPA	91,120	4.28	390,358.08	
TERNA SPA	71,827	7.49	538,127.88	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	31,150	27.92	869,708.00	
VERBUND AG	2,780	73.55	204,469.00	
ASM INTERNATIONAL NV	2,105	675.80	1,422,559.00	
ASML HOLDING NV	17,202	953.00	16,393,506.00	
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	3,290	153.60	505,344.00	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	56,495	36.50	2,062,067.50	
STMICROELECTRONICS NV	29,593	39.40	1,166,112.16	
LEG IMMOBILIEN SE	3,010	77.20	232,372.00	
VONOVIA SE	33,969	26.98	916,483.62	
ユーロ小計	7,919,260		217,282,843.16 (36,642,578,670)	
英ポンド				
BP PLC	728,918	4.60	3,353,022.80	
SHELL PLC-NEW	277,807	27.11	7,531,347.77	
ANGLO AMERICAN PLC	54,004	23.88	1,289,885.54	
ANTOFAGASTA PLC	17,080	20.41	348,602.80	
CRODA INTERNATIONAL PLC	6,131	41.27	253,026.37	
ENDEAVOUR MINING PLC	6,490	16.10	104,489.00	
GLENCORE PLC	453,603	4.54	2,061,852.43	
MONDI PLC	16,700	14.63	244,321.00	
RIO TINTO PLC	48,325	52.19	2,522,081.75	
ASHTREAD GROUP PLC	20,500	54.22	1,111,510.00	

BAE SYSTEMS PLC ORD	124,235	13.35	1,658,537.25
BUNZL PLC	17,316	29.22	505,973.52
DCC PLC	3,820	55.50	212,010.00
MELROSE INDUSTRIES PLC	63,400	6.00	380,780.40
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	353,031	4.57	1,616,175.91
SMITHS GROUP PLC	13,603	16.81	228,666.43
SPIRAX GROUP PLC	2,890	84.85	245,216.50
EXPERIAN PLC	37,408	37.07	1,386,714.56
INTERTEK GROUP PLC	6,025	47.44	285,826.00
RELX PLC	81,345	35.58	2,894,255.10
RENTOKIL INITIAL PLC	115,300	4.47	515,506.30
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	40,720	4.88	199,080.08
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	4,515	50.30	227,104.50
BURBERRY GROUP PLC	15,504	9.80	151,970.20
PERSIMMON PLC	12,440	14.20	176,648.00
TAYLOR WIMPEY PLC	124,090	1.48	184,025.47
COMPASS GROUP PLC	72,268	22.17	1,602,181.56
ENTAIN PLC	24,860	6.56	163,081.60
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	7,366	138.35	1,019,086.10
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	7,473	81.80	611,291.40
PEARSON PLC	26,089	9.49	247,584.61
WHITBREAD PLC	8,110	29.12	236,163.20
AUTO TRADER GROUP PLC	36,480	8.19	298,771.20
INFORMA PLC	56,580	8.42	476,629.92
WPP PLC	41,144	7.35	302,572.97
JD SPORTS FASHION PLC	97,350	1.20	117,550.12
KINGFISHER PLC	78,137	2.48	194,248.58
NEXT PLC	5,667	90.08	510,483.36
SAINSBURY (J) PLC	70,601	2.58	182,715.38
TESCO PLC	288,058	3.10	893,555.91
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	13,125	24.83	325,893.75
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	84,677	23.92	2,025,473.84
COCA-COLA HBC AG-CDI	11,230	26.92	302,311.60
DIAGEO PLC	95,292	25.79	2,457,580.68
IMPERIAL BRANDS PLC	38,792	19.99	775,646.04
HALEON PLC	298,551	3.24	968,200.89
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	30,695	43.93	1,348,431.35
UNILEVER PLC	106,352	44.50	4,732,664.00
NMC HEALTH PLC	8,090	-	-
SMITH & NEPHEW PLC	33,906	9.99	338,924.37
ASTRAZENECA PLC	66,122	125.10	8,271,862.20
GSK PLC	179,430	16.04	2,878,954.35
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	5,740	19.58	112,389.20

BARCLAYS PLC	639,751	2.02	1,292,297.02	
HSBC HOLDINGS PLC	821,661	6.76	5,561,001.64	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,649,936	0.54	1,435,735.32	
NATWEST GROUP PLC	275,835	3.07	847,365.12	
STANDARD CHARTERED PLC	95,420	7.24	691,031.64	
3I GROUP PLC	40,649	30.40	1,235,729.60	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	13,020	10.51	136,840.20	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	20,707	94.34	1,953,498.38	
M&G PLC	99,522	2.00	199,541.61	
SCHRODERS PLC	30,300	3.70	112,352.40	
WISE PLC - A	29,200	7.13	208,342.00	
ADMIRAL GROUP PLC	12,845	25.51	327,675.95	
AVIVA PLC	134,324	4.76	639,382.24	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	294,051	2.24	660,732.59	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	30,230	4.80	145,285.38	
PRUDENTIAL PLC	121,002	7.00	847,014.00	
SAGE GROUP PLC/THE	49,540	10.56	523,390.10	
HALMA PLC	14,690	26.45	388,550.50	
BT GROUP PLC	267,752	1.39	373,647.91	
VODAFONE GROUP PLC	996,528	0.68	687,205.70	
CENTRICA PLC	209,200	1.32	276,144.00	
NATIONAL GRID PLC	204,765	8.82	1,806,027.30	
SEVERN TRENT PLC	13,573	24.74	335,796.02	
SSE PLC	43,667	17.67	771,595.89	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	26,105	10.36	270,578.32	
英債券小計	11,571,658		82,809,638.69 (16,551,162,484)	
スイスフラン				
CLARIANT AG-REG	7,990	13.50	107,865.00	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	270	732.50	197,775.00	
GIVAUDAN-REG	378	4,296.00	1,623,888.00	
HOLCIM LTD	22,219	80.04	1,778,408.76	
SIG GROUP AG	10,900	16.06	175,054.00	
SIKA AG-REG	6,605	255.90	1,690,219.50	
ABB LTD-REG	68,855	49.89	3,435,175.95	
GEBERIT AG-REG	1,490	542.20	807,878.00	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,070	230.50	246,635.00	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,480	235.40	348,392.00	
VAT GROUP AG	1,295	497.50	644,262.50	
ADECCO GROUP AG-REG	6,817	31.10	212,008.70	
SGS SA-REG	5,950	81.80	486,710.00	
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	2,810	256.50	720,765.00	
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	23,289	143.85	3,350,122.65	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	1,525	185.25	282,506.25	

SWATCH GROUP AG/THE-REG	1,950	36.60	71,370.00		
AVOLTA AG	3,460	36.12	124,975.20		
BARRY CALLEBAUT AG-REG	130	1,553.00	201,890.00		
CHOCOLAFABRIKEN LINDT-PC	40	10,750.00	430,000.00		
CHOCOLAFABRIKEN LINDT-REG	5	109,400.00	547,000.00		
NESTLE SA-REG	115,080	95.28	10,964,822.40		
ALCON INC	21,254	80.44	1,709,671.76		
SONOVA HOLDING AG-REG	2,051	276.90	567,921.90		
STRAUMANN HOLDING AG-REG	5,520	110.60	610,512.00		
BACHEM HOLDING AG	1,400	79.25	110,950.00		
LONZA GROUP AG-REG	3,333	480.30	1,600,839.90		
NOVARTIS AG-REG	85,643	95.01	8,136,941.43		
ROCHE HOLDING AG-BR	1,640	273.60	448,704.00		
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	30,123	247.60	7,458,454.80		
SANDOZ GROUP AG	21,268	31.89	678,236.52		
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	1,510	94.60	142,846.00		
JULIUS BAER GROUP LTD	8,420	50.60	426,052.00		
PARTNERS GROUP HOLDING AG	995	1,154.50	1,148,727.50		
UBS GROUP AG-REG	142,282	26.92	3,830,231.44		
BALOISE HOLDING AG - REG	1,740	155.30	270,222.00		
HELVETIA HOLDING AG-REG	1,320	117.90	155,628.00		
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	1,285	632.20	812,377.00		
SWISS RE AG	12,289	108.90	1,338,272.10		
ZURICH INSURANCE GROUP AG	6,241	471.40	2,942,007.40		
TEMENOS AG	2,280	59.90	136,572.00		
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	6,660	88.38	588,610.80		
SWISSCOM AG-REG	1,024	496.00	507,904.00		
BKW AG	840	140.70	118,188.00		
SWISS PRIME SITE-REG	3,441	83.40	286,979.40		
スイスフラン小計	646,167		62,474,573.86 (11,048,003,641)		
スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	10,290	339.40	3,492,426.00	
	HOLMEN AB-B SHARES	3,520	425.80	1,498,816.00	
	SVENSKA CELLULOZA AB-B SHS	22,680	155.05	3,516,534.00	
	ALFA LAVAL AB	15,220	464.60	7,071,212.00	
	ASSA ABLOY AB-B	42,940	302.40	12,985,056.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	111,390	200.20	22,300,278.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	67,170	172.95	11,617,051.50	
	BEIJER REF AB	15,480	164.55	2,547,234.00	
	EPIROC AB-A	31,565	211.80	6,685,467.00	
	EPIROC AB-B	15,450	192.50	2,974,125.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	15,000	88.40	1,326,000.00	
	INDUTRADE AB	10,180	272.20	2,770,996.00	

INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	6,800	296.00	2,012,800.00		
LIFCO AB-B SHS	8,470	283.40	2,400,398.00		
NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	63,000	47.26	2,977,380.00		
SAAB AB-B	11,120	241.00	2,679,920.00		
SANDVIK AB	49,820	215.70	10,746,174.00		
SKANSKA AB-B SHS	14,390	187.55	2,698,844.50		
SKF AB-B SHARES-B	14,079	207.10	2,915,760.90		
TRELLEBORG AB-B SHS	9,190	403.60	3,709,084.00		
VOLVO AB-A SHS	9,530	268.80	2,561,664.00		
VOLVO AB-B SHS-B	63,450	263.60	16,725,420.00		
SECURITAS AB-B SHS	17,788	104.00	1,849,952.00		
VOLVO CAR AB-B	39,400	32.20	1,268,680.00		
EVOLUTION AB	8,150	1,056.00	8,606,400.00		
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	27,848	188.60	5,252,132.80		
ESSITY AKTIEBOLAG-B	29,035	278.60	8,089,151.00		
GETINGE AB-B SHS	9,470	182.80	1,731,116.00		
SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB	8,148	270.00	2,199,960.00		
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	72,400	152.80	11,062,720.00		
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	60,120	100.25	6,027,030.00		
SWEDBANK AB - A SHARES	34,550	214.60	7,414,430.00		
EQT AB	14,450	312.50	4,515,625.00		
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	4,984	355.00	1,769,320.00		
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	5,980	353.70	2,115,126.00		
INVESTOR AB-B SHS	69,350	283.75	19,678,062.50		
LUNDBERGS AB-B SHS	3,590	516.50	1,854,235.00		
ERICSSON LM-B SHS	114,915	61.78	7,099,448.70		
HEXAGON AB-B SHS	94,990	116.50	11,066,335.00		
TELE2 AB-B SHS	23,245	104.40	2,426,778.00		
TELIA CO AB	118,530	26.76	3,171,862.80		
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	23,220	68.54	1,591,498.80		
SAGAX AB-B	7,910	266.40	2,107,224.00		
スウェーデンクローナ小計	1,398,807		239,109,728.50 (3,579,472,635)		
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	12,100	255.10	3,086,710.00	
	EQUINOR ASA	39,014	289.70	11,302,355.80	
	NORSK HYDRO A S	50,660	64.84	3,284,794.40	
	YARA INTERNATIONAL ASA	6,670	298.20	1,988,994.00	
	KONGSBERG GRUPPEN ASA	3,900	871.50	3,398,850.00	
	MOWI ASA	16,360	189.45	3,099,402.00	
	ORKLA ASA	32,290	90.20	2,912,558.00	
	SALMAR ASA	3,590	605.00	2,171,950.00	
	DNB BANK ASA	45,435	205.70	9,345,979.50	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	7,410	189.00	1,400,490.00	

	TELENOR ASA	23,915	122.90	2,939,153.50	
ノルウェークローネ小計		241,344		44,931,237.20 (663,634,373)	
デンマーククローネ	NOVONESIS (NOVOZYMES) B	16,690	407.40	6,799,506.00	
	ROCKWOOL A/S-B SHS	315	2,750.00	866,250.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	41,480	182.05	7,551,434.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - A	115	11,120.00	1,278,800.00	
	AP MOELLER - MAERSK A/S - B	195	11,400.00	2,223,000.00	
	DSV A/S	7,890	1,081.50	8,533,035.00	
	PANDORA A/S	3,310	1,052.50	3,483,775.00	
	CARLSBERG AS-B	3,910	938.20	3,668,362.00	
	COLOPLAST-B	6,475	851.60	5,514,110.00	
	DEMANT A/S	3,640	326.40	1,188,096.00	
	GENMAB A/S	2,920	1,832.50	5,350,900.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	140,550	991.00	139,285,050.00	
	DANSKE BANK A/S	31,185	202.40	6,311,844.00	
	TRYG A/S	13,945	143.10	1,995,529.50	
ORSTED A/S	7,570	385.80	2,920,506.00		
デンマーククローネ小計		280,190		196,970,197.50 (4,451,526,463)	
豪ドル	AMPOL LTD	8,775	33.10	290,452.50	
	SANTOS LTD	151,760	7.47	1,133,647.20	
	WOODSIDE ENERGY GROUP LTD	84,316	27.26	2,298,454.16	
	BHP GROUP LTD	215,437	43.09	9,283,180.33	
	BLUESCOPE STEEL LTD	18,310	20.54	376,087.40	
	FORTESCUE LTD	73,745	23.20	1,710,884.00	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI	20,365	48.30	983,629.50	
	MINERAL RESOURCES LTD	7,320	62.37	456,548.40	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	53,090	13.43	712,998.70	
	ORICA LIMITED	17,675	18.00	318,150.00	
	PILBARA MINERALS LTD	114,530	3.24	371,077.20	
	RIO TINTO LTD	16,698	120.20	2,007,099.60	
	SOUTH32 LTD	207,787	3.66	760,500.42	
	REECE LTD	10,200	25.84	263,568.00	
	SEVEN GROUP HOLDINGS LTD	8,410	39.44	331,690.40	
	BRAMBLES LTD	54,798	14.52	795,666.96	
	COMPUTERSHARE LTD	20,910	26.47	553,487.70	
	AURIZON HOLDINGS LTD	73,570	3.65	268,530.50	
	QANTAS AIRWAYS LTD	35,030	6.11	214,033.30	
	TRANSURBAN GROUP	129,996	12.50	1,624,950.00	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	23,520	46.68	1,097,913.60		
LOTTERY CORP LTD/THE	85,554	5.19	444,025.26		
CAR GROUP LTD	14,500	35.07	508,515.00		

	REA GROUP LTD	1,820	192.08	349,585.60	
	SEEK LTD	12,860	23.06	296,551.60	
	WESFARMERS LTD	47,855	67.40	3,225,427.00	
	COLES GROUP LTD	57,925	16.99	984,145.75	
	ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	50,462	5.05	254,833.10	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	54,692	32.59	1,782,412.28	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	43,206	12.06	521,064.36	
	COCHLEAR LTD	2,947	323.51	953,383.97	
	PRO MEDICUS LTD	2,450	131.17	321,366.50	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	7,105	48.29	343,100.45	
	SONIC HEALTHCARE LTD	17,660	25.34	447,504.40	
	CSL LTD	20,712	289.10	5,987,839.20	
	ANZ GROUP HOLDINGS LTD	126,149	28.75	3,626,783.75	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	71,217	125.31	8,924,202.27	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	135,333	35.02	4,739,361.66	
	WESTPAC BANKING CORP	148,101	26.79	3,967,625.79	
	ASX LTD	7,105	56.45	401,077.25	
	MACQUARIE GROUP LTD	16,084	190.74	3,067,862.16	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	8,370	32.39	271,104.30	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	95,125	6.59	626,873.75	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	108,430	3.69	400,106.70	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	70,410	18.31	1,289,207.10	
	SUNCORP GROUP LTD	55,536	16.39	910,235.04	
	WISETECH GLOBAL LTD	7,450	96.15	716,317.50	
	XERO LTD	5,960	130.94	780,402.40	
	TELSTRA GROUP LTD	164,284	3.50	574,994.00	
	APA GROUP	45,818	8.35	382,580.30	
	ORIGIN ENERGY LTD	68,320	10.08	688,665.60	
豪ドル小計		2,899,682		73,639,703.91 (7,671,047,956)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	47,165	7.47	352,558.37	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	23,130	30.77	711,710.10	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	76,577	4.04	309,371.08	
	MERCURY NZ LTD	34,100	6.69	228,129.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	57,830	6.37	368,377.10	
ニュージーランドドル小計		238,802		1,970,145.65 (190,434,278)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	125,708	36.85	4,632,339.80	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	58,500	95.60	5,592,600.00	
	MTR CORP	62,500	24.90	1,556,250.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	52,000	20.70	1,076,400.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	91,000	39.05	3,553,550.00	
	SANDS CHINA LTD	96,600	17.80	1,719,480.00	

	WH GROUP LTD	299,894	5.17	1,550,451.98	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	148,000	24.40	3,611,200.00	
	HANG SENG BANK LTD	36,900	107.20	3,955,680.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	52,800	257.60	13,601,280.00	
	AIA GROUP LTD	482,390	55.50	26,772,645.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	150,000	8.73	1,309,500.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L	25,000	43.65	1,091,250.00	
	CLP HOLDINGS LTD	71,500	65.40	4,676,100.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	456,237	5.93	2,705,485.41	
	POWER ASSETS HOLDINGS	58,000	42.60	2,470,800.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	80,538	29.40	2,367,817.20	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	57,901	21.45	1,241,976.45	
	SINO LAND CO	189,050	8.22	1,553,991.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	60,480	71.60	4,330,368.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	17,517	70.10	1,227,941.70	
	SWIRE PROPERTIES LTD	41,600	13.18	548,288.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	43,000	23.15	995,450.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	63,800	21.55	1,374,890.00	
香港ドル小計		2,820,915		93,515,734.54 (1,885,277,208)	
シンガポールドル	KEPPEL LTD	68,560	6.53	447,696.80	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	63,300	3.98	251,934.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	53,900	6.73	362,747.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	211,100	0.87	183,657.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	73,960	3.07	227,057.20	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	84,034	35.48	2,981,526.32	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	150,740	14.14	2,131,463.60	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	57,300	30.57	1,751,661.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	42,500	9.53	405,025.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	354,480	2.55	903,924.00	
	SEMBICORP INDUSTRIES LTD	30,200	5.04	152,208.00	
	CAPITALAND INVESTMENT LTD/SI	105,000	2.63	276,150.00	
シンガポールドル小計		1,295,074		10,075,049.92 (1,173,441,064)	
イスラエルシェケル	ICL GROUP LTD	39,490	16.49	651,190.10	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,010	674.80	681,548.00	
	BANK HAPUALIM BM	50,495	33.01	1,666,839.95	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	62,565	30.49	1,907,606.85	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	48,330	18.71	904,254.30	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	6,900	130.60	901,140.00	
	NICE LTD	3,040	621.70	1,889,968.00	
	AZRIELI GROUP LTD	1,780	224.20	399,076.00	
		213,610		9,001,623.20	

イスラエルシュケル小計			(381,225,043)
合 計	46,866,269		412,973,561,923 (412,973,561,923)

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

(2)株式以外の有価証券

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
米ドル	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	6,910	803,771.20	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	12,110	429,178.40	
		AMERICAN TOWER CORP	20,219	3,983,749.57	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	18,847	381,086.34	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,790	1,168,943.10	
		BOSTON PROPERTIES INC	5,717	352,395.88	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,810	519,672.40	
		CROWN CASTLE INC	18,590	1,842,269.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	12,525	1,877,748.00	
		EQUINIX INC	3,978	3,048,182.28	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	6,550	410,816.00	
		EQUITY RESIDENTIAL-REIT	15,450	1,030,669.50	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,020	841,070.00	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	8,800	1,377,816.00	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	11,340	492,269.40	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	36,875	724,593.75	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	33,579	598,377.78	
		INVITATION HOMES INC	25,700	912,350.00	
		IRON MOUNTAIN INC	13,365	1,176,387.30	
		KIMCO REALTY CORP	29,910	560,812.50	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,630	784,371.60	
		PROLOGIS INC	39,585	4,444,999.65	
		PUBLIC STORAGE	6,849	1,939,979.25	
		REALTY INCOME CORP	35,661	1,903,227.57	
		REGENCY CENTERS CORP	7,565	467,290.05	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	4,735	927,870.60	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	13,394	1,993,429.02	
		SUN COMMUNITIES INC	5,920	690,508.80	
		UDR INC	12,100	487,388.00	
		VENTAS INC	17,025	852,952.50	
VICI PROPERTIES INC	45,610	1,290,306.90			
WELLTOWER INC	23,830	2,479,273.20			
WEYERHAEUSER CO	29,998	869,942.00			
WP CAREY INC	8,610	482,934.90			
米ドル小計			550,597	42,146,632.44 (6,639,359,008)	

加ドル	投資証券	CANADIAN APARTMENT PROPERTIES RE INVST	2,800	122,332.00	
加ドル小計			2,800	122,332.00 (14,030,257)	
ユーロ	投資証券	COVIVIO	1,925	86,201.50	
		GECINA SA	1,950	178,522.50	
		KLEPIERRE	8,402	214,587.08	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	4,990	361,775.00	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	7,730	195,569.00	
ユーロ小計			24,997	1,036,655.08 (174,821,512)	
英ポンド	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	26,624	165,601.28	
		SEGRO PLC	65,733	597,512.97	
英ポンド小計			92,357	763,114.25 (152,523,645)	
豪ドル	投資証券	DEXUS/AU	42,067	273,014.83	
		GOODMAN GROUP	70,642	2,526,864.34	
		GPT GROUP	71,335	290,333.45	
		MIRVAC GROUP	159,875	301,364.37	
		SCENTRE GROUP	198,271	618,605.52	
		STOCKLAND	102,400	454,656.00	
		VICINITY CENTRES	154,902	288,117.72	
豪ドル小計			799,492	4,752,956.23 (495,115,450)	
香港ドル	投資証券	LINK REIT	104,160	3,395,616.00	
香港ドル小計			104,160	3,395,616.00 (68,455,618)	
シンガポールドル	投資証券	CAPITALAND ASCENDAS REIT	138,243	355,284.51	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	209,556	406,538.64	
シンガポールドル小計			347,799	761,823.15 (88,729,542)	
合計				7,633,035,032 (7,633,035,032)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

(注3)券面総額欄の数値は、口数を表示しております。

外貨建有価証券の内訳

種 類	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 580銘柄	97.9%		75.3%
	投資証券 34銘柄		2.1%	1.6%
加ドル	株式 85銘柄	99.9%		3.0%
	投資証券 1銘柄		0.1%	0.0%
ユーロ	株式 217銘柄	99.5%		8.7%
	投資証券 5銘柄		0.5%	0.0%
英ポンド	株式 78銘柄	99.1%		3.9%
	投資証券 2銘柄		0.9%	0.0%

スイスフラン	株式	45銘柄	100.0%		2.6%
スウェーデンクローナ	株式	43銘柄	100.0%		0.9%
ノルウェークローネ	株式	11銘柄	100.0%		0.2%
デンマーククローネ	株式	15銘柄	100.0%		1.1%
豪ドル	株式	51銘柄	93.9%		1.8%
	投資証券	7銘柄		6.1%	0.1%
ニュージーランドドル	株式	5銘柄	100.0%		0.0%
香港ドル	株式	24銘柄	96.5%		0.4%
	投資証券	1銘柄		3.5%	0.0%
シンガポールドル	株式	12銘柄	93.0%		0.3%
	投資証券	2銘柄		7.0%	0.0%
イスラエルシケル	株式	8銘柄	100.0%		0.1%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2024年 6月28日現在です。

【世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型】

【純資産額計算書】

資産総額	39,917,047,013円
負債総額	29,535,739円
純資産総額（ - ）	39,887,511,274円
発行済口数	33,079,656,908口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2058円

（参考）

日本リートインデックスJ - R E I Tマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	60,573,639,844円
負債総額	206,662円
純資産総額（ - ）	60,573,433,182円
発行済口数	24,750,633,165口
1口当たり純資産額（ / ）	2.4473円

海外リートインデックス（ヘッジなし）マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	57,608,427,790円
負債総額	1,978,012円
純資産総額（ - ）	57,606,449,778円
発行済口数	16,473,045,346口
1口当たり純資産額（ / ）	3.4970円

日本債券インデックスマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	54,885,943,810円
負債総額	227,196,628円
純資産総額（ - ）	54,658,747,182円
発行済口数	41,805,050,113口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3075円

海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	173,552,228,039円
------	------------------

負債総額	364,457,643円
純資産総額（ - ）	173,187,770,396円
発行済口数	55,576,358,206口
1口当たり純資産額（ / ）	3.1162円

日本株式インデックスTOPIXマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	62,177,635,714円
負債総額	94,929,007円
純資産総額（ - ）	62,082,706,707円
発行済口数	21,303,718,331口
1口当たり純資産額（ / ）	2.9142円

海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	442,755,576,537円
負債総額	130,131,777円
純資産総額（ - ）	442,625,444,760円
発行済口数	64,262,099,397口
1口当たり純資産額（ / ）	6.8878円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

- (1) 名義書換
受益者は、委託会社がやむを得ない事情などにより受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求を行なわないものとします。
- (2) 受益者に対する特典
該当事項はありません。
- (3) 譲渡制限の内容
譲渡制限はありません。
受益権の譲渡
・受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。
・前述の申請のある場合には、振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社債、株式等の振替に関する法律の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。
・前述の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合などにおいて、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。
受益権の譲渡の対抗要件
受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。
- (4) 受益証券の再発行
受益者は、委託会社がやむを得ない事情などにより受益証券を発行する場合を除き、受益証券の再発行の請求を行なわないものとします。
- (5) 受益権の再分割
委託会社は、受託会社と協議のうえ、社債、株式等の振替に関する法律に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。
- (6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて
振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、解約請求の受付、解約金および償還金の支払いなどについては、約款の規定によるほか、民法その他の法令などにしたがって取り扱われます。

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

2024年6月末現在	資本金	17,363,045,900円
	発行可能株式総数	230,000,000株
	発行済株式総数	197,012,500株

過去5年間における主な資本金の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の意思決定機関（2024年6月末現在）

・株主総会

株主総会は、取締役の選任および定款変更に係る決議などの株式会社の基本的な方針や重要な事項の決定を行ないます。

当社は、毎年3月31日の最終の株主名簿に記載または記録された議決権を有する株主をもって、その事業年度に関する定時株主総会において、その権利を行使することができる株主とみなし、毎年3月31日（事業年度の終了）から3ヶ月以内にこれを招集し、臨時株主総会は必要に応じてこれを招集します。

・取締役会

取締役会は、業務執行の決定を行い、取締役の職務の執行の監督をします。また、取締役会の決議によって重要な業務執行（会社法第399条の13第5項各号に掲げる事項を除く。）の決定の全部又は一部を取締役に委任することができます。

当社の取締役会は10名以内の取締役（監査等委員である取締役を除く。）及び5名以内の監査等委員である取締役で構成され、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとします。取締役会はその決議をもって、取締役（監査等委員である取締役を除く。）の中から、代表取締役若干名を選定します。

・監査等委員会

当社の監査等委員会は、5名以内の監査等委員である取締役で構成され、監査等委員である取締役の任期は選任後2年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとします。監査等委員会は、その決議をもって、監査等委員の中から、常勤の監査等委員を選定します。

(3) 運用の意思決定プロセス（2024年6月末現在）

- 投資委員会にて、国内外の経済見通し、市況見通しおよび資産配分の基本方針を決定します。
- 各運用部門は、投資委員会の決定に基づき、個別資産および資産配分戦略に係る具体的な運用方針を策定します。
- 各運用部門のファンドマネージャーは、上記方針を受け、個別ファンドのガイドラインおよびそれぞれの運用方針に沿って、ポートフォリオを構築・管理します。
- トレーディング部門は、社会的信用力、情報提供力、執行対応力において最適と判断し得る発注業者、発注方針などを決定します。その上で、トレーダーは、最良執行のプロセスに則り売買を執行します。
- 運用状況の評価・分析および運用リスク（流動性リスクを含む）の管理ならびに法令など遵守状況のモニタリングについては、運用部門から独立したリスク管理/コンプライアンス業務担当部門が担当し、これを運用部門にフィードバックすることにより、適切な運用体制を維持できるように努めています。

2【事業の内容及び営業の概況】

- 「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行なっています。
- 委託会社の運用する、2024年6月末現在の投資信託などは次の通りです。

種類	ファンド本数	純資産額 (単位：億円)
投資信託総合計	783	313,367
株式投資信託	737	274,014
単位型	279	8,535
追加型	458	265,479
公社債投資信託	46	39,352
単位型	33	980
追加型	13	38,371

3【委託会社等の経理状況】

- 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）

並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)に基づいて作成しております。

2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第65期事業年度(2023年4月1日から2024年3月31日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

		(単位：百万円)	
		第64期 (2023年3月31日)	第65期 (2024年3月31日)
資産の部			
流動資産			
現金・預金		42,036	31,198
金銭の信託		-	3,899
有価証券		1,025	1
前払費用		908	814
未収入金	4	410	179
未収委託者報酬		21,336	21,592
未収収益	3	589	647
関係会社短期貸付金		3,318	-
立替金		1,015	1,089
その他	2	1,233	2,011
流動資産合計		71,875	61,434
固定資産			
有形固定資産			
建物	1	245	233
器具備品	1	122	134
有形固定資産合計		367	368
無形固定資産			
ソフトウェア		390	438
無形固定資産合計		390	438
投資その他の資産			
投資有価証券		23,274	28,465
関係会社株式		22,366	37,647
長期差入保証金		375	285
繰延税金資産		448	-
投資その他の資産合計		46,465	66,398
固定資産合計		47,224	67,205
資産合計		119,099	128,640

(単位：百万円)

		第64期 (2023年3月31日)	第65期 (2024年3月31日)
負債の部			
流動負債			
預り金		433	451
未払金		7,557	9,211
未払収益分配金		7	7
未払償還金		71	71
未払手数料		6,586	8,330

その他未払金		892		803
未払費用	3	4,227	3	4,082
未払法人税等		-		1,644
未払消費税等		-	4	620
賞与引当金		2,563		2,619
役員賞与引当金		218		232
その他		647		683
流動負債合計		15,648		19,547
固定負債				
退職給付引当金		1,424		1,448
賞与引当金		437		565
役員賞与引当金		16		56
繰延税金負債		-		295
その他		181		251
固定負債合計		2,059		2,617
負債合計		17,708		22,165
純資産の部				
株主資本				
資本金		17,363		17,363
資本剰余金				
資本準備金		5,220		5,220
資本剰余金合計		5,220		5,220
利益剰余金				
その他利益剰余金				
繰越利益剰余金		79,307		82,591
利益剰余金合計		79,307		82,591
自己株式		2,067		2,067
株主資本合計		99,823		103,107
評価・換算差額等				
その他有価証券評価差額金		2,056		4,523
繰延ヘッジ損益		488		1,155
評価・換算差額等合計		1,567		3,367
純資産合計		101,391		106,475
負債純資産合計		119,099		128,640

(2) 【損益計算書】

(単位：百万円)

	第64期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)		第65期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬		73,998		75,874
その他営業収益		3,479	1	3,714
営業収益合計		77,477		79,588
営業費用				
支払手数料		30,699		32,917
広告宣伝費		755		711
公告費		3		3
調査費		17,479		17,736
調査費		1,170		1,266
委託調査費		16,282		16,445
図書費		26		23

委託計算費	581	610
営業雑経費	948	881
通信費	139	135
印刷費	309	308
協会費	56	48
諸会費	16	11
その他	427	375
営業費用計	50,469	52,860
一般管理費		
給料	9,818	10,550
役員報酬	314	459
役員賞与引当金繰入額	234	273
給料・手当	6,544	6,791
賞与	147	277
賞与引当金繰入額	2,577	2,747
交際費	56	71
寄付金	24	22
旅費交通費	205	260
租税公課	433	389
不動産賃借料	938	906
退職給付費用	383	388
退職金	155	36
固定資産減価償却費	183	199
福利費	1,097	1,208
諸経費	4,291	4,661
一般管理費計	17,588	18,694
営業利益	9,420	8,033

(単位：百万円)

	第64期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)		第65期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)	
営業外収益				
受取利息		107		4
受取配当金	2	9,255	2	4,946
有価証券評価益		-	3	1,113
金銭の信託運用益		-		399
時効成立分配金・償還金		1		2
その他		236		50
営業外収益合計		9,601		6,517
営業外費用				
支払利息		407		569
デリバティブ費用		389		3,494
有価証券償還損		6		-
時効成立後支払分配金・償還金		1		1
為替差損		342		165
その他		15		0
営業外費用合計		1,163		4,231
経常利益		17,858		10,319
特別利益				
投資有価証券売却益		427		815
訴訟損失引当金戻入額	4	4,481		-
特別利益合計		4,909		815

特別損失		
投資有価証券売却損	347	174
固定資産処分損	0	52
損害賠償損失	-	167
特別損失合計	347	394
税引前当期純利益	22,420	10,740
法人税、住民税及び事業税	1,340	2,415
法人税等調整額	3,252	51
法人税等合計	4,593	2,364
当期純利益	17,826	8,376

(3) 【株主資本等変動計算書】

第64期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本						株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	68,901	68,901	2,067	89,417
当期変動額							
剰余金の配当				7,420	7,420		7,420
当期純利益				17,826	17,826		17,826
自己株式の取得							
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）							
当期変動額合計	-	-	-	10,406	10,406	-	10,406
当期末残高	17,363	5,220	5,220	79,307	79,307	2,067	99,823

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	評価・ 換算差額 等合計	
当期首残高	2,350	731	1,618	91,035
当期変動額				
剰余金の配当				7,420
当期純利益				17,826
自己株式の取得				
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	294	242	51	51
当期変動額合計	294	242	51	10,355
当期末残高	2,056	488	1,567	101,391

第65期（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本						株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		自己株式	
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計		
当期首残高	17,363	5,220	5,220	79,307	79,307	2,067	99,823
当期変動額							

剰余金の配当				5,092	5,092		5,092
当期純利益				8,376	8,376		8,376
自己株式の取得							
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)							
当期変動額合計	-	-	-	3,284	3,284	-	3,284
当期末残高	17,363	5,220	5,220	82,591	82,591	2,067	103,107

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	評価・ 換算差額 等合計	
当期首残高	2,056	488	1,567	101,391
当期変動額				
剰余金の配当				5,092
当期純利益				8,376
自己株式の取得				
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	2,467	666	1,800	1,800
当期変動額合計	2,467	666	1,800	5,084
当期末残高	4,523	1,155	3,367	106,475

[注記事項]

(重要な会計方針)

項目	第65期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
1 資産の評価基準及び評価方法	(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法 その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 時価法(評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は、総平均法により算定) 市場価格のない株式等 総平均法による原価法 (2) 金銭の信託 時価法 (3) デリバティブ 時価法
2 固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法により償却しております。ただし、2016年4月1日以後に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。 建物 3年～15年 器具備品 3年～20年 (2) 無形固定資産 定額法により償却しております。ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。
3 引当金の計上基準	(1) 賞与引当金 従業員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。 (2) 役員賞与引当金 役員に支給する賞与の支払に充てるため、支払見込額に基づき、当事業年度の負担額を計上しております。

4 収益の計上基準	<p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異の費用処理方法 数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。</p> <p>当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。</p> <p>(1) 投資信託委託業務 当社は、投資信託契約に基づき投資信託商品に関する投信委託サービスを提供し、商品の運用資産残高（以下「AUM」）に応じて手数料を受領しております。サービスの提供を通じて得られる投資信託報酬は、各ファンドのAUMに固定料率を乗じて毎日計算され、日次で収益を認識しております。</p> <p>(2) 投資顧問業務 当社は、投資顧問契約に基づき機関投資家に投資顧問サービスを提供し、ファンドのAUMに応じて手数料を受領しております。サービスの提供を通じて得られる投資顧問報酬は、一般的に各ファンドのAUMに投資顧問契約で定められた固定料率を乗じて毎月計算され、月次で収益を認識しております。</p> <p>(3) 成功報酬 当社がファンドの運用成果に応じて受領する成功報酬は、投資信託契約または投資顧問契約のもと、報酬を受領することが確実であり、将来返還する可能性が無いことが判明した時点で収益を認識しております。</p>
5 ヘッジ会計の方法	<p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段は為替予約、ヘッジ対象は投資有価証券であります。</p> <p>(3) ヘッジ方針 ヘッジ取引規程等に基づき、ヘッジ対象に係る為替変動リスクをヘッジしてあります。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 ヘッジ開始時から有効性判定時点までの期間における相場変動によるヘッジ手段及びヘッジ対象資産に係る損益の累計を比較し有効性を評価してあります。</p>
6 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>消費税等の会計処理 資産に係る控除対象外消費税及び地方消費税は、当事業年度の費用として処理してあります。</p>

(重要な会計上の見積り)

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
該当事項はありません。

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
該当事項はありません。

(貸借対照表関係)

第64期 (2023年3月31日)	第65期 (2024年3月31日)
<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 1,437百万円</p> <p>器具備品 879百万円</p>	<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建物 1,482百万円</p> <p>器具備品 920百万円</p>
<p>2 信託資産</p> <p>流動資産のその他のうち2百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託してあります。</p>	<p>2 信託資産</p> <p>流動資産のその他のうち2百万円は、「直販顧客分別金信託契約」により、野村信託銀行株式会社に信託してあります。</p>

<p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。</p> <p>(流動資産) 未収収益 263百万円</p> <p>(流動負債) 未払費用 1,778百万円</p> <p>4 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未収入金」に含めて表示しております。</p> <p>5 保証債務 ティンダルエクイティーズ・オーストラリア・ピーティーワイ・リミテッド(旧社名「日興AMエクイティーズ・オーストラリア・ピーティーワイ・リミテッド」)が発行する買戻し条件付株式の買戻請求に関する債務について、ヤラ・キャピタル・マネジメント・リミテッドは最大448百万円(5百万豪ドル)を提供する義務を負っています。当社はヤラ・キャピタル・マネジメント・リミテッドが負う当該資金提供義務を保証しております。</p>	<p>3 関係会社に対する資産及び負債は次のとおりであります。</p> <p>(流動資産) 未収収益 248百万円</p> <p>(流動負債) 未払費用 1,873百万円</p> <p>4 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。</p> <p>5 保証債務 ティンダルエクイティーズ・オーストラリア・ピーティーワイ・リミテッド(旧社名「日興AMエクイティーズ・オーストラリア・ピーティーワイ・リミテッド」)が発行する買戻し条件付株式の買戻請求に関する債務について、ヤラ・キャピタル・マネジメント・リミテッドは最大493百万円(5百万豪ドル)を提供する義務を負っています。当社はヤラ・キャピタル・マネジメント・リミテッドが負う当該資金提供義務を保証しております。</p>
--	---

(損益計算書関係)

第64期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第65期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
-	1 営業収益合計には、成功報酬212百万円が含まれております。
2 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金 9,241百万円	2 各科目に含まれている関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金 4,889百万円
-	3 有価証券評価益 保有している一部の有価証券の区分を、運用方針の変更のためその他有価証券から売買目的有価証券に振り替え、金銭の信託に移管したことに伴い、振替時の評価差額1,113百万円を営業外収益に計上しております。
4 訴訟損失引当金戻入額 原告との和解が成立したことにより、前事業年度に計上した訴訟損失引当金から、和解金を控除した額を計上しております。	-

(株主資本等変動計算書関係)

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式(株)	197,012,500	-	-	197,012,500

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式(株)	2,860,000	-	-	2,860,000

3 新株予約権等に関する事項

	新株予約権の目的となる株式の数(株)
--	--------------------

新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末	当事業年度末残高(百万円)
2016年度 ストックオプション(1)	普通株式	88,000	-	88,000	-	-
2016年度 ストックオプション(2)	普通株式	816,000	-	599,000	217,000	-
2017年度 ストックオプション(1)	普通株式	1,536,000	-	784,000	752,000	-
合計		2,440,000	-	1,471,000	969,000	-

(注) 1 当事業年度の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。

2 2016年度ストックオプション(2)217,000株及び2017年度ストックオプション(1)752,000株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額(百万円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2022年5月27日 取締役会	普通株式	7,420	38.22	2022年3月31日	2022年6月27日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額(百万円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2023年5月26日 取締役会	普通株式	利益剰余金	5,092	26.23	2023年3月31日	2023年6月27日

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式(株)	197,012,500	-	-	197,012,500

2 自己株式の種類及び株式数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式(株)	2,860,000	-	-	2,860,000

3 新株予約権等に関する事項

新株予約権の内訳	新株予約権の目的となる株式の種類	新株予約権の目的となる株式の数(株)				当事業年度末残高(百万円)
		当事業年度期首	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末	
2016年度 ストックオプション(2)	普通株式	217,000	-	96,000	121,000	-
2017年度 ストックオプション(1)	普通株式	752,000	-	406,000	346,000	-
合計		969,000	-	502,000	467,000	-

(注) 1 当事業年度の減少は、新株予約権の失効等によるものであります。

2 2016年度ストックオプション(2)121,000株及び2017年度ストックオプション(1)346,000株は、当事業年度末現在、権利行使期間の初日が到来しておりますが、他の条件が満たされていないため新株予約権を行使することができません。

4 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額(百万円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
2023年5月26日 取締役会	普通株式	5,092	26.23	2023年3月31日	2023年6月27日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2024年5月29日 取締役会	普通株式	利益剰余金	11,183	57.60	2024年3月31日	2024年6月25日

(リース取引関係)

第64期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第65期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料	オペレーティング・リース取引 解約不能のものに係る未経過リース料
1年内 899百万円	1年内 891百万円
1年超 3,425百万円	1年超 2,613百万円
合計 4,324百万円	合計 3,505百万円

(金融商品関係)

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、自社が運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を有価証券及び投資有価証券として保有しております。当社が行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託に係る将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため、有価証券及び投資有価証券保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

また、資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

預金に関しては10数行に分散して預入れしておりますが、これら金融機関の破綻及び債務不履行等による信用リスクに晒されております。営業債権である未収委託者報酬及び未収収益に関しては、それらの源泉である預り純資産を数行の信託銀行に分散して委託しておりますが、信託銀行はその受託資産を自己勘定と分別して管理しているため、仮に信託銀行が破綻又は債務不履行等となった場合でも、これら営業債権が信用リスクに晒されることは無いと考えております。また、グローバルに事業を展開していることから生じている外貨建ての営業債権は、為替の変動リスクに晒されます。有価証券及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引により、リスクをヘッジしております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計(繰延ヘッジ)を適用しております。デリバティブ取引は、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針」5「ヘッジ会計の方法」をご参照下さい。

営業債務である未払金(未払手数料)、未払費用に関しては、すべてが1年以内の支払期日であります。未払金(未払手数料)については、債権(未収委託者報酬)を資金回収した後に、販売会社へ当該債務を支払うフローとなっているため、流動性リスクに晒されることは無いと考えております。また未払費用のうち運用再委託先への顧問料支払に係るものについてもほとんどのものが、未払金同様のフローのため、流動性リスクに晒されることは無いと考えております。それ以外の営業費用及び一般管理費に係る未払費用に関しては、流動性リスクに晒されており、一部は外貨建て債務があるため、為替の変動リスクにも晒されております。

上記以外の外貨建ての債権及び債務に関しては、為替変動リスクに晒されておりますが、一部が為替予約によりリスクをヘッジしております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

当社は、預金の預入れやデリバティブ取引を行う金融機関の選定に関しては、相手方の財政状態及び経営成績、又は必要に応じて格付等を考慮した上で決定しております。また既に取引が行われている相手方に関しても、定期的に継続したモニタリングを行うことで、相手方の財務状況の悪化等による信用リスクを早期に把握することで、リスクの軽減を図っております。

市場リスク(為替や価格等の変動リスク)の管理

当社は、原則、有価証券及び投資有価証券以外の為替変動や価格変動に係るリスクに対して、ヘッジ取引を行っておりません。外貨建ての営業債権債務について、月次ベースで為替変動リスクを測定し、モニタリングを実施しております。また、有価証券及び投資有価証券に関しては、一部について、為替変動リスクや価格変動リスクを回避する目的でデリバティブ取引を行っております。毎月末にそれぞれの時価を算出し、評価損益(ヘッジ対象の有価証券及び投資有価証券は、ヘッジ損益考慮後の評価損益)を把握しております。また、市場の変動等に基づき、今後の一定期間において特定の確率で、金融商品に生じ得る損失額の推計値を把握するため、バリュエーション・アット・リスクを用いた市場リスク管理を週次ベースで実施しております。さらに、外貨建ての貸付金に関しては、為替変動リスクを回避する目的でデリバティブ取引を行っております。

流動性リスク(支払期日に支払いを実行できなくなるリスク)の管理

当社は、日々資金残高管理を行っております。また、適時に資金繰予定表を作成・更新するとともに、手許流動性(最低限必要な運転資金)を状況に応じて見直し・維持すること等により、流動性リスクを管理しております。

2 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、市場価格

のない株式等は、次表には含めておりません。

また、金融商品の時価は、時価の算定に用いたインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下3つのレベルに分類しております。

- レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価
- レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価
- レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

(1) 時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
有価証券 其他有価証券 投資信託	6,238	18,045	-	24,283
資産計	6,238	18,045	-	24,283
デリバティブ取引(*1) 株式関連(*2) 通貨関連(*3)	246	-	-	246
	-	352	-	352
デリバティブ取引計	246	352	-	599

- (1) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、で示しております。
- (2) 株式関連のデリバティブ取引のうち 246百万円は、貸借対照表上流動資産及び流動負債のその他に含まれております。
- (3) 通貨関連のデリバティブ取引の 352百万円は、貸借対照表上流動負債のその他に含まれております。

(2) 時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

現金・預金、未収委託者報酬、未収収益、関係会社短期貸付金、未払金及び未払費用は、短期間（1年以内）で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

資産

有価証券

上場投資信託は、取引所の価格を時価としており、市場の活発性に基づき、レベル1の時価に分類しております。市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買取請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限が無い場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。

デリバティブ取引

株式関連

株価指数先物取引は活発な市場における無調整の相場価格を利用できることから、その時価をレベル1に分類しております。

通貨関連

為替予約の時価は、金利や為替レート等の観察可能なインプットを用いて割引現在価値法により算定しており、レベル2の時価に分類しております。

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

(単位：百万円)

区分	貸借対照表計上額
非上場株式	16
子会社株式	17,183
関連会社株式	5,183

3 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	42,036			
未収委託者報酬	21,336			
未収収益	589			
有価証券及び投資有価証券 投資信託	1,025	204	4,520	10
合計	64,987	204	4,520	10

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、自らが運用する投資信託の商品性維持を目的として、当該投資信託を有価証券及び投資有価証券として保有しております。当社が行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託に係る将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため、有価証券及び投資有価証券保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

また、資金運用については金銭の信託及び短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

預金に関しては10数行に分散して預入れしておりますが、これら金融機関の破綻及び債務不履行等による信用リスクに晒されております。営業債権である未収委託者報酬及び未収収益に関しては、それらの源泉である預り純資産を数行の信託銀行に分散して委託しておりますが、信託銀行はその受託資産を自己勘定と分別して管理しているため、仮に信託銀行が破綻又は債務不履行等となった場合でも、これら営業債権が信用リスクに晒されることは無いと考えております。また、グローバルに事業を展開していることから生じている外貨建ての営業債権は、為替の変動リスクに晒されます。有価証券及び投資有価証券は、主に自己で設定した投資信託へのシードマネーの投入によるものであります。これら投資信託の投資対象は株式、公社債等のため、価格変動リスクや信用リスク、流動性リスク、為替変動リスクに晒されておりますが、それらの一部については為替予約、株価指数先物等のデリバティブ取引により、リスクをヘッジしております。なお、為替変動リスクに係るヘッジについてはヘッジ会計（繰延ヘッジ）を適用しております。デリバティブ取引は、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の「重要な会計方針「5 ヘッジ会計の方法」」をご参照下さい。

営業債務である未払金（未払手数料）、未払費用に関しては、すべてが1年以内の支払期日であります。未払金（未払手数料）については、債権（未収委託者報酬）を資金回収した後に、販売会社へ当該債務を支払うフローとなっているため、流動性リスクに晒されることは無いと考えております。また未払費用のうち運用再委託先への顧問料支払に係るものについてもほとんどのものが、未払金同様のフローのため、流動性リスクに晒されることは無いと考えております。それ以外の営業費用及び一般管理費に係る未払費用に関しては、流動性リスクに晒されており、一部は外貨建て債務があるため、為替の変動リスクにも晒されております。

上記以外の外貨建ての債権及び債務に関しては、為替変動リスクに晒されておりますが、一部為替予約によりリスクをヘッジしております。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

当社は、預金の預入れやデリバティブ取引を行う金融機関の選定に関しては、相手方の財政状態及び経営成績、又は必要に応じて格付等を考慮した上で決定しております。また既に取引が行われている相手方に関して、定期的継続したモニタリングを行うことで、相手方の財務状況の悪化等による信用リスクを早期に把握することで、リスクの軽減を図っております。

市場リスク（為替や価格等の変動リスク）の管理

当社は、原則、有価証券及び投資有価証券以外の為替変動や価格変動に係るリスクに対して、ヘッジ取引を行っておりません。外貨建ての営業債権債務について、月次ベースで為替変動リスクを測定し、モニタリングを実施しております。また、有価証券及び投資有価証券に関しては、一部について、為替変動リスクや価格変動リスクを回避する目的でデリバティブ取引を行っております。毎月末にそれぞれの時価を算出し、評価損益（ヘッジ対象の有価証券及び投資有価証券は、ヘッジ損益考慮後の評価損益）を把握しております。また、市場の変動等に基づき、今後の一定期間において特定の確率で、金融商品に生じ得る損失額の推計値を把握するため、バリュー・アット・リスクを用いた市場リスク管理を週次ベースで実施しております。さらに、外貨建ての貸付金に関しては、為替変動リスクを回避する目的でデリバティブ取引を行っております。

流動性リスク（支払期日に支払いを実行できなくなるリスク）の管理

当社は、日々資金残高管理を行っております。また、適時に資金繰予定表を作成・更新するとともに、手許流動性（最低限必要な運転資金）を状況に応じて見直し・維持すること等により、流動性リスクを管理しております。

2 金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びレベルごとの内訳等については、次のとおりであります。なお、市場価格のない株式等は、次表には含めておりません。

また、金融商品の時価は、時価の算定に用いたインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価：観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

(1) 時価をもって貸借対照表価額とする金融資産及び金融負債

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
金銭の信託 有価証券	-	3,899	-	3,899

その他有価証券 投資信託	7,785	18,141	-	25,927
資産計	7,785	22,041	-	29,827
デリバティブ取引(*1)				
株式関連 (*2)	309	-	-	309
通貨関連 (*3)	-	367	-	367
デリバティブ取引計	309	367	-	677

(1) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、で示しております。

(2) 株式関連のデリバティブ取引の 309百万円は、貸借対照表上流動資産及び流動負債のその他に含まれております。

(3) 通貨関連のデリバティブ取引の 367百万円は、貸借対照表上流動負債のその他に含まれております。

(2) 時価をもって貸借対照表価額としない金融資産及び金融負債

現金・預金、未収委託者報酬、未収収益、関係会社短期貸付金、未払金及び未払費用は、短期間（1年以内）で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

(注1) 時価の算定に用いた評価技法及びインプットの説明

資産

金銭の信託

金銭の信託の信託財産のうち、市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買取請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限が無い場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。金銭の信託の信託財産のうち、銀行勘定貸については取引先金融機関から提供された価格により算定しており、当該価格は活発な市場における相場価格とは認められないため、レベル2の時価に分類しております。

有価証券

上場投資信託は、取引所の価格を時価としており、市場の活発性に基づき、レベル1の時価に分類しております。市場における取引価格が存在しない投資信託については、解約又は買取請求に関して市場参加者からリスクの対価を求められるほどの重要な制限が無い場合には基準価額等を時価としており、レベル2の時価に分類しております。

デリバティブ取引

株式関連

株価指数先物取引は活発な市場における無調整の相場価格を利用できることから、その時価をレベル1に分類しております。

通貨関連

為替予約の時価は、金利や為替レート等の観察可能なインプットを用いて割引現在価値法により算定しており、レベル2の時価に分類しております。

(注2) 市場価格のない株式等の貸借対照表計上額は次のとおりであります。

(単位：百万円)

区分	貸借対照表計上額
非上場株式	2,540
子会社株式	19,011
関連会社株式	18,635

3 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	31,198			
未収委託者報酬	21,592			
未収収益	647			
有価証券及び投資有価証券 投資信託	1	169	2,483	-
合計	53,440	169	2,483	-

(有価証券関係)

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	17,183
関連会社株式	5,183

(注) 子会社株式及び関連会社株式は市場価格のない株式等であるため、時価を記載しておりません。

2 その他有価証券

(単位:百万円)

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額 が取得原価を超え るもの	投資信託	17,219	13,860	3,359
	小計	17,219	13,860	3,359
貸借対照表計上額 が取得原価を超え ないもの	投資信託	7,063	7,459	395
	小計	7,063	7,459	395
合計		24,283	21,319	2,963

(注) 1 減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合にはすべて減損処理を行い、30%～50%程度下落した場合には、当該金額の重要性、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。

2 非上場株式等(貸借対照表計上額 16百万円)については、市場価格のない株式等であることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位:百万円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
投資信託	11,194	1,349	221
合計	11,194	1,349	221

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

1 子会社株式及び関連会社株式

(単位:百万円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	19,011
関連会社株式	18,635

(注) 子会社株式及び関連会社株式は市場価格のない株式等であるため、時価を記載しておりません。

2 その他有価証券

(単位:百万円)

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額 が取得原価を超え るもの	投資信託	24,313	17,701	6,611
	小計	24,313	17,701	6,611
貸借対照表計上額 が取得原価を超え ないもの	投資信託	1,613	1,769	156
	小計	1,613	1,769	156
合計		25,927	19,471	6,455

(注) 1 減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合にはすべて減損処理を行い、30%～50%程度下落した場合には、当該金額の重要性、回復可能性等を考慮して必要と認められた額について減損処理を行っております。

2 非上場株式等(貸借対照表計上額2,540百万円)については、市場価格のない株式等であることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位:百万円)

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
投資信託	8,145	1,057	167
合計	8,145	1,057	167

4 保有目的を変更した有価証券

注記事項「（損益計算書関係） 3 有価証券評価益」をご参照ください。

（金銭の信託関係）

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

該当事項はありません。

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

運用目的の金銭の信託

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額	当事業年度の損益に含まれた 評価差額
運用目的の金銭の信託	3,899	399

（デリバティブ取引関係）

第64期(2023年3月31日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

種類	契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引 株価指数先物取引 売建	10,970	-	246	246
合計	10,970	-	246	246

(注) 1 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しております。

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

(2) 通貨関連

種類	契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引 以外の取引 為替予約取引 売建 シンガポール ドル	3,275	-	24	24
合計	3,275	-	24	24

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

通貨関連

ヘッジ会計の 方法	デリバティブ取引の 種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的処理 方法	為替予約取引 売建 米ドル 豪ドル 香港ドル 人民元 ユーロ	投資有価証券	6,132	-	280
			105	-	0
			699	-	34
			5,822	-	1
			234	-	10
			合計	12,994	-

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

第65期(2024年3月31日)

1 ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(1) 株式関連

種類	契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)	評価損益 (百万円)
市場取引 株価指数先物取引 売建	15,077	-	309	309
合計	15,077	-	309	309

(注) 1 上記取引については時価評価を行い、評価損益は損益計算書に計上しております。

2 時価の算定方法

金融商品取引所が定める清算指数によっております。

(2) 通貨関連

該当事項はありません。

2 ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

通貨関連

ヘッジ会計の方法	デリバティブ取引の種類等	主なヘッジ対象	契約額等 (百万円)	契約額等 のうち1年超 (百万円)	時価 (百万円)
原則的処理 方法	為替予約取引 売建	投資有価証券			
	米ドル		6,465	-	268
	豪ドル		84	-	2
	香港ドル		542	-	17
	人民元		2,979	-	17
	ユーロ		2,172	-	60
	合計		12,243	-	367

(注) 1 時価の算定方法

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しております。

(持分法損益等)

第64期 (自 2022年 4月 1日 至 2023年 3月31日)	第65期 (自 2023年 4月 1日 至 2024年 3月31日)
関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)	関連会社に持分法を適用した場合の投資損益等 (単位：百万円)
(1) 関連会社に対する投資の金額 5,326	(1) 関連会社に対する投資の金額 5,342
(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 16,722	(2) 持分法を適用した場合の投資の金額 17,691
(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 2,185	(3) 持分法を適用した場合の投資利益の金額 2,474

(退職給付関係)

第64期(自 2022年 4月 1日 至 2023年 3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定拠出型企業年金制度及びキャッシュバランスプラン型退職金制度を設けております。

2 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(百万円)
退職給付債務の期首残高	1,352
勤務費用	133
利息費用	4
数理計算上の差異の発生額	16
退職給付の支払額	107
退職給付債務の期末残高	1,366

(2) 退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

退職給付債務	1,366
未積立退職給付債務	1,366
未認識数理計算上の差異	58
貸借対照表に計上された負債の額	1,424

退職給付引当金	1,424
貸借対照表に計上された負債の額	1,424

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	133
利息費用	4
数理計算上の差異の費用処理額	1

確定給付制度に係る退職給付費用	136
-----------------	-----

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項
 当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎
 割引率 0.6%

3 確定拠出制度
 当社の確定拠出制度への要拠出額は、247百万円でありました。

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

1 採用している退職給付制度の概要
 当社は、確定拠出型企業年金制度及びキャッシュバランスプラン型退職金制度を設けております。

2 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	(百万円)
退職給付債務の期首残高	1,366
勤務費用	134
利息費用	8
数理計算上の差異の発生額	9
退職給付の支払額	110
退職給付債務の期末残高	1,407

(2) 退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

退職給付債務	1,407
未積立退職給付債務	1,407
未認識数理計算上の差異	40
貸借対照表に計上された負債の額	1,448
退職給付引当金	1,448
貸借対照表に計上された負債の額	1,448

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	134
利息費用	8
数理計算上の差異の費用処理額	7
確定給付制度に係る退職給付費用	134

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項
 当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎
 割引率 0.7%

3 確定拠出制度
 当社の確定拠出制度への要拠出額は、253百万円でありました。

(ストックオプション等関係)

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

	2016年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(2)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 16名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 31名
株式の種類別のストックオプション の付与数 (注)	普通株式 4,437,000株	普通株式 4,409,000株
付与日	2016年7月15日	2017年4月27日

権利確定条件	2018年7月15日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	2019年4月27日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで
権利行使期間	2018年7月15日から 2026年7月31日まで	2019年4月27日から 2027年4月30日まで

	2017年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 36名
株式の種類別のストックオプションの付与数(注)	普通株式 4,422,000株
付与日	2018年4月27日
権利確定条件	2020年4月27日(以下「権利行使可能初日」といいます。)、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで
権利行使期間	2020年4月27日から 2028年4月30日まで

(注) 株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況
ストックオプション(新株予約権)の数

	2016年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(2)
付与日	2016年7月15日	2017年4月27日
権利確定前(株)		
期首	88,000	816,000
付与	0	0
失効	88,000	599,000
権利確定	0	0
権利未確定残	-	217,000
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

	2017年度ストックオプション(1)
付与日	2018年4月27日

権利確定前(株)	
期首	1,536,000
付与	0
失効	784,000
権利確定	0
権利未確定残	752,000
権利確定後(株)	
期首	-
権利確定	-
権利行使	-
失効	-
権利未行使残	-

(注) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

	2016年度ストックオプション(1)	2016年度ストックオプション(2)
付与日	2016年7月15日	2017年4月27日
権利行使価格(円)	558	553
付与日における公正な評価単価(円) (注)1	0	0

	2017年度ストックオプション(1)
付与日	2018年4月27日
権利行使価格(円)	694
付与日における公正な評価単価(円) (注)1	0

(注) 1 公正な評価単価に代え、本源的価値（評価額と行使価格との差額）の見積りによっております。

2 スtockオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
当事業年度末における本源的価値の合計額 344百万円

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

1 スtockオプション(新株予約権)の内容、規模及びその変動状況

(1) スtockオプション(新株予約権)の内容

	2016年度ストックオプション(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与対象者の区分及び人数	当社及び関係会社の 取締役・従業員 31名	当社及び関係会社の 取締役・従業員 36名
株式の種類別のストックオプションの付与数 (注)	普通株式 4,409,000株	普通株式 4,422,000株
付与日	2017年4月27日	2018年4月27日
権利確定条件	2019年4月27日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。	2020年4月27日（以下「権利行使可能初日」といいます。）、当該権利行使可能初日から1年経過した日の翌日、及び当該権利行使可能初日から2年経過した日の翌日まで原則として従業員等の地位にあることを要し、それぞれ保有する新株予約権の3分の1、3分の1、3分の1ずつ権利確定する。ただし、本新株予約権の行使時において、当社が株式公開していることを要する。
対象勤務期間	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで	付与日から、権利行使可能初日から2年を経過した日まで
権利行使期間	2019年4月27日から 2027年4月30日まで	2020年4月27日から 2028年4月30日まで

(注) 株式数に換算して記載しております。

(2) ストックオプション(新株予約権)の規模及びその変動状況
ストックオプション(新株予約権)の数

	2016年度ストックオプション(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与日	2017年4月27日	2018年4月27日
権利確定前(株)		
期首	217,000	752,000
付与	0	0
失効	96,000	406,000
権利確定	0	0
権利未確定残	121,000	346,000
権利確定後(株)		
期首	-	-
権利確定	-	-
権利行使	-	-
失効	-	-
権利未行使残	-	-

(注) 株式数に換算して記載しております。

単価情報

	2016年度ストックオプション(2)	2017年度ストックオプション(1)
付与日	2017年4月27日	2018年4月27日
権利行使価格(円)	553	694
付与日における公正な評価単価 (円) (注) 1	0	0

(注) 1 公正な評価単価に代え、本源的価値(評価額と行使価格との差額)の見積りによっております。

2 ストックオプションの単位当たりの本源的価値による算定を行った場合の本源的価値の合計額
当事業年度末における本源的価値の合計額 104百万円

(税効果会計関係)

第64期 (2023年3月31日)	第65期 (2024年3月31日)

1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	1 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳
(単位：百万円)	(単位：百万円)
繰延税金資産	繰延税金資産
賞与引当金 918	賞与引当金 975
投資有価証券評価損 97	投資有価証券評価損 8
関係会社株式評価損 52	関係会社株式評価損 52
退職給付引当金 436	退職給付引当金 443
固定資産減価償却費 83	固定資産減価償却費 80
繰延ヘッジ損益 215	繰延ヘッジ損益 510
その他 672	その他 679
繰延税金資産小計 2,478	繰延税金資産小計 2,750
評価性引当金 52	評価性引当金 52
繰延税金資産合計 2,425	繰延税金資産合計 2,697
繰延税金負債	繰延税金負債
その他有価証券評価差額金 1,028	その他有価証券評価差額金 2,044
その他 948	その他 948
繰延税金負債合計 1,977	繰延税金負債合計 2,992
繰延税金資産の純額 448	繰延税金負債の純額 295
2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳	2 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳
法定実効税率 30.6%	法定実効税率 30.6%
(調整)	(調整)
交際費等永久に損金に算入されない項目 1.0%	交際費等永久に損金に算入されない項目 1.2%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目 12.0%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目 10.9%
その他 0.8%	その他 1.1%
税効果会計適用後の法人税等の負担率 20.5%	税効果会計適用後の法人税等の負担率 22.0%

(関連当事者情報)

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	232,369 (SGD千)	アセットマネジメント業	直接100.00	-	資金の貸付(シンガポールドル貸建)(注1)	-	関係会社短期貸付金	3,318 (SGD 33,000千)
							貸付金利息(シンガポールドル貸建)(注1)	103 (SGD 1,043千)	未収収益	55 (SGD 551千)
							資金の返済(米国ドル貸建)(注2)	2,019 (USD 16,500千)	関係会社短期貸付金	-
							貸付金利息(米国ドル貸建)(注2)	3 (USD 26千)	未収収益	-

子会社	Nikko AM Americas Holding Co., Inc.	米国	131,079 (USD千) (注3)	アセット マネジメン ト業	直接100.00	-	配当の受取	7,795 (USD 58,000千)	-	-
-----	-------------------------------------	----	---------------------------	---------------------	----------	---	-------	---------------------------	---	---

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

1. 融資枠55百万シンガポールドル、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
2. 融資枠5,300百万円(若しくは5,300百万円相当額の外国通貨)、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定してあります(決定方針等を2022年8月26日付にて上記1に変更しております)。
3. Nikko AM Americas Holding Co., Inc.の資本金は、資本金及び資本剰余金の合計額を記載しております。

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社(東京証券取引所等に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は2022年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場で円貨に換算したものであります。

資産合計	34,828百万円
負債合計	5,655百万円
純資産合計	29,173百万円
営業収益	15,864百万円
税引前当期純利益	4,191百万円
当期純利益	3,159百万円

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

1 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社と関連当事者の取引

(ア) 財務諸表提出会社の親会社

重要な該当事項はありません。

(イ) 財務諸表提出会社の子会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Nikko Asset Management International Limited	シンガポール国	232,369 (SGD千)	アセット マネジメン ト業	直接 100.00	-	資金の返済 (シンガポールドル貸建) (注1)	3,318 (SGD 33,000千)	関係会社 短期 貸付金	-
							貸付金利息 (シンガポールドル貸建) (注1)	22 (SGD 223千)	未収収益	-
							関係会社 株式の取得 (注2)	13,412	-	-
子会社	Nikko AM Americas Holding Co., Inc.	米国	131,079 (USD千) (注3)	アセット マネジメン ト業	直接 100.00	-	配当の受取	2,950 (USD 20,000千)	-	-
子会社	Nikko AM Global Holdings Limited	英国	3,378	アセット マネジメン ト業	直接 100.00	-	増資の引受 (注4)	1,828	-	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

1. 融資枠55百万シンガポールドル、返済期間1年間のリボルビング・ローンで、金利は市場金利を勘案して決定しております。
2. Nikko Asset Management International Limitedが保有する関連会社AHAM Asset Management Berhadの20%の株式を、2023年4月19日に13,412百万円で取得しました。
3. Nikko AM Americas Holding Co., Inc.の資本金は、資本金及び資本剰余金の合計額を記載しております。
4. Nikko AM Global Holdings Limitedの行った1,828,000,000株の新株発行増資を、1株につき1円で当社が引受けたものであります。

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

三井住友トラスト・ホールディングス株式会社（東京証券取引所等に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

当事業年度において、重要な関連会社は融通(ロントン)基金管理有限公司であり、その要約財務情報は以下のとおりであります。なお、下記数値は2023年12月31日に終了した年度の財務諸表を当日の直物為替相場で円貨に換算したものであります。

資産合計	41,322百万円
負債合計	8,314百万円
純資産合計	33,008百万円

営業収益	18,682百万円
税引前当期純利益	6,005百万円
当期純利益	4,538百万円

(セグメント情報等)

セグメント情報

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

当社はアセットマネジメント業の単一セグメントであるため、記載しておりません。

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

当社はアセットマネジメント業の単一セグメントであるため、記載しておりません。

関連情報

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービスはアセットマネジメント業として単一であるため、記載しておりません。

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

国内の外部顧客への営業収益に分類した額が営業収益の90%超であるため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

1 製品及びサービスごとの情報

当社の製品及びサービスはアセットマネジメント業として単一であるため、記載しておりません。

2 地域ごとの情報

(1) 営業収益

国内の外部顧客への営業収益に分類した額が営業収益の90%超であるため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

国外に所在している有形固定資産が無いため、該当事項はありません。

3 主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客が無いため、記載しておりません。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
該当事項はありません。

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
該当事項はありません。

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)
該当事項はありません。

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
該当事項はありません。

(収益認識関係)

第64期(自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)

1 顧客との契約から生じる収益を分解した情報
重要性が乏しいため記載を省略しております。

2 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報は、「(重要な会計方針) 4 収益の計上基準」に記載のとおりです。

3 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において存在する顧客との契約から当事業年度の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

第65期(自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)

1 顧客との契約から生じる収益を分解した情報
重要性が乏しいため記載を省略しております。

2 顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報は、「(重要な会計方針) 4 収益の計上基準」に記載のとおりです。

3 顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において存在する顧客との契約から当事業年度の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

(1株当たり情報)

項目	第64期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第65期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
1株当たり純資産額	522円22銭	548円41銭
1株当たり当期純利益金額	91円81銭	43円14銭

(注) 1 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、新株予約権の残高はありますが、当社株式が非上場であるため、期中平均株価が把握できませんので、希薄化効果を算定できないため記載していません。

2 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第64期 (自 2022年4月1日 至 2023年3月31日)	第65期 (自 2023年4月1日 至 2024年3月31日)
当期純利益(百万円)	17,826	8,376
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-	-

普通株式に係る当期純利益（百万円）	17,826	8,376
普通株式の期中平均株式数（千株）	194,152	194,152
希薄化効果を有しないため、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額の算定に含まれなかった潜在株式の概要	2016年度ストックオプション（2）217,000株、2017年度ストックオプション（1）752,000株	2016年度ストックオプション（2）121,000株、2017年度ストックオプション（1）346,000株

3 1株当たり純資産額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

項目	第64期 (2023年3月31日)	第65期 (2024年3月31日)
純資産の部の合計額（百万円）	101,391	106,475
純資産の部の合計額から控除する金額（百万円）	-	-
普通株式に係る期末の純資産額（百万円）	101,391	106,475
1株当たり純資産額の算定に用いられた期末の普通株式の数（千株）	194,152	194,152

（重要な後発事象）
該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (2) 運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (3) 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下（4）、（5）において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または金融デリバティブ取引を行なうこと。
- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。
- (5) 上記（3）、（4）に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

- (1) 定款の変更
委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。
- (2) 訴訟事件その他の重要事項
委託会社に重要な影響を与えた事実、または与えると予想される訴訟事件などは発生していません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名 称	資本金の額 (2024年3月末現在)	事業の内容
野村信託銀行株式会社	50,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 (2024年3月末現在)	事業の内容
アイザワ証券株式会社 1	3,000百万円	

あかつき証券株式会社	3,067百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。	
auカブコム証券株式会社	7,196百万円		
S M B C 日興証券株式会社	135,000百万円		
株式会社 S B I 証券	54,323百万円		
大和証券株式会社	100,000百万円		
東海東京証券株式会社	6,000百万円		
東洋証券株式会社 1	13,494百万円		
野村證券株式会社 1	10,000百万円		
八十二証券株式会社 1	3,000百万円		
フィデリティ証券株式会社	12,657百万円 (2023年12月末現在)		
松井証券株式会社	11,945百万円		
マネックス証券株式会社	13,195百万円		
楽天証券株式会社	19,495百万円		
株式会社秋田銀行 1	14,100百万円		銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社香川銀行	14,105百万円		
株式会社佐賀共栄銀行	2,679百万円		
株式会社三十三銀行 1	37,461百万円		
株式会社滋賀銀行	33,076百万円		
スルガ銀行株式会社	30,043百万円		
株式会社東和銀行	38,653百万円		
株式会社鳥取銀行	9,061百万円		
株式会社富山銀行 1	6,730百万円		
株式会社八十二銀行	52,243百万円		
株式会社百十四銀行	37,322百万円		
株式会社南日本銀行	13,351百万円		
株式会社武蔵野銀行	45,743百万円		
株式会社琉球銀行	56,967百万円		
株式会社 S M B C 信託銀行	87,550百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。	
みずほ信託銀行株式会社 1	247,369百万円		
農林中央金庫	4,040,198百万円	全国の農業協同組合、漁業協同組合、森林組合などの協同組織の全国金融機関として、余剰資金の効率運用と資金の需給調整、当該協同組織の信用力の維持向上および業務機能の補完を図っています。	
労働金庫連合会	120,000百万円 (出資の総額)	労働金庫法に基づき設立された労働金庫の系統中央金融機関です。	

1 募集の取扱いを行いません。

名 称	資本金の額 (2023年3月末現在)	事業の内容
埼玉県信用農業協同組合連合会	165,600百万円	農業協同組合法に基づき信用事業等を営んでおります。
東京都信用農業協同組合連合会	133,489百万円	
神奈川県信用農業協同組合連合会	203,600百万円	
長野県信用農業協同組合連合会	105,381百万円	
新潟県信用農業協同組合連合会	74,400百万円	
石川県信用農業協同組合連合会	33,047百万円	
静岡県信用農業協同組合連合会	161,300百万円	
愛知県信用農業協同組合連合会	253,402百万円	
三重県信用農業協同組合連合会	68,752百万円	
滋賀県信用農業協同組合連合会	40,700百万円	
大阪府信用農業協同組合連合会	140,600百万円	
兵庫県信用農業協同組合連合会	263,320百万円	

和歌山県信用農業協同組合連合会	57,883百万円
山口県信用農業協同組合連合会	35,542百万円
徳島県信用農業協同組合連合会	32,500百万円
仙台農業協同組合	3,439百万円
みやぎ亘理農業協同組合	1,486百万円
みやぎ登米農業協同組合	6,138百万円
新みやぎ農業協同組合	10,165百万円
いしのまき農業協同組合	4,648百万円
みやぎ仙南農業協同組合	3,696百万円
秋田しんせい農業協同組合	5,102百万円
山形農業協同組合	3,872百万円
さがえ西村山農業協同組合	3,596百万円
山形おきたま農業協同組合	4,466百万円
鶴岡市農業協同組合	1,438百万円
庄内たがわ農業協同組合	4,079百万円
ふくしま未来農業協同組合	16,254百万円
茨城みなみ農業協同組合	1,556百万円
北つくば農業協同組合	3,588百万円
はが野農業協同組合	3,956百万円
那須南農業協同組合	1,178百万円
高崎市農業協同組合	2,163百万円
佐波伊勢崎農業協同組合	2,499百万円
さいたま農業協同組合	8,290百万円
あさか野農業協同組合	852百万円
いるま野農業協同組合	5,516百万円
埼玉中央農業協同組合	2,296百万円
くまがや農業協同組合	2,700百万円
ほくさい農業協同組合	3,093百万円
越谷市農業協同組合	2,007百万円
南彩農業協同組合	2,894百万円
埼玉みずほ農業協同組合	1,519百万円
さいかつ農業協同組合	1,819百万円
ふかや農業協同組合	1,668百万円
横浜農業協同組合	11,625百万円
セレサ川崎農業協同組合	2,484百万円
よこすか葉山農業協同組合	1,336百万円
さがみ農業協同組合	5,008百万円
湘南農業協同組合	3,138百万円
秦野市農業協同組合	1,622百万円
かながわ西湘農業協同組合	2,353百万円
厚木市農業協同組合	2,394百万円
相模原市農業協同組合	832百万円
神奈川つくい農業協同組合	746百万円
佐久浅間農業協同組合	7,254百万円
信州うえだ農業協同組合	3,960百万円
信州諏訪農業協同組合	6,169百万円
上伊那農業協同組合	8,017百万円
みなみ信州農業協同組合	4,332百万円
松本ハイランド農業協同組合	9,118百万円
大北農業協同組合	3,038百万円
グリーン長野農業協同組合	3,809百万円
中野市農業協同組合	2,513百万円
ながの農業協同組合	13,160百万円
北新潟農業協同組合	7,165百万円 (2024年3月1日現在)
新潟かがやき農業協同組合	12,669百万円

えちご中越農業協同組合	15,899百万円 (2023年2月1日現在)
魚沼農業協同組合	7,961百万円 (2024年2月1日現在)
佐渡農業協同組合	2,269百万円
加賀農業協同組合	1,942百万円
小松市農業協同組合	2,100百万円
能美農業協同組合	1,276百万円
金沢中央農業協同組合	1,062百万円
金沢市農業協同組合	3,081百万円
はくい農業協同組合	1,359百万円
能登わかば農業協同組合	2,496百万円
能登農業協同組合	1,379百万円
ぎふ農業協同組合	7,078百万円
西美濃農業協同組合	4,416百万円
いび川農業協同組合	1,935百万円
めぐみの農業協同組合	4,906百万円
東美濃農業協同組合	2,639百万円
飛騨農業協同組合	6,501百万円
富士伊豆農業協同組合	10,964百万円
清水農業協同組合	2,866百万円
静岡市農業協同組合	1,796百万円
大井川農業協同組合	3,229百万円
ハイナン農業協同組合	808百万円
掛川市農業協同組合	790百万円
遠州夢咲農業協同組合	3,349百万円
遠州中央農業協同組合	3,181百万円
とびあ浜松農業協同組合	3,605百万円
三ヶ日町農業協同組合	290百万円
尾張中央農業協同組合	2,051百万円
西春日井農業協同組合	152百万円
あいち尾東農業協同組合	1,177百万円
愛知北農業協同組合	741百万円
愛知西農業協同組合	1,584百万円
あいち知多農業協同組合	6,666百万円
あいち中央農業協同組合	3,605百万円
西三河農業協同組合	1,301百万円
あいち三河農業協同組合	1,096百万円
あいち豊田農業協同組合	1,789百万円
愛知東農業協同組合	909百万円
豊橋農業協同組合	2,437百万円
鈴鹿農業協同組合	1,587百万円
津安芸農業協同組合	2,513百万円
伊勢農業協同組合	6,405百万円
伊賀ふるさと農業協同組合	3,989百万円
甲賀農業協同組合	2,598百万円
北大阪農業協同組合	1,779百万円
茨木市農業協同組合	1,186百万円
大阪泉州農業協同組合	1,886百万円
いずみの農業協同組合	2,736百万円
堺市農業協同組合	1,200百万円
大阪南農業協同組合	3,529百万円
グリーン大阪農業協同組合	1,387百万円
大阪中河内農業協同組合	4,097百万円
北河内農業協同組合	2,849百万円
大阪市農業協同組合	2,494百万円
兵庫南農業協同組合	3,701百万円

兵庫西農業協同組合	12,787百万円
たじま農業協同組合	4,315百万円
丹波ひかみ農業協同組合	2,128百万円
淡路日の出農業協同組合	1,807百万円
奈良県農業協同組合	9,248百万円
わかやま農業協同組合	4,900百万円
ながみね農業協同組合	2,110百万円
紀の里農業協同組合	3,993百万円
紀北川上農業協同組合	4,978百万円
ありだ農業協同組合	2,152百万円
紀州農業協同組合	3,846百万円
紀南農業協同組合	4,887百万円
みくまの農業協同組合	1,184百万円
鳥取いなば農業協同組合	5,582百万円
鳥取中央農業協同組合	3,528百万円
鳥取西部農業協同組合	4,937百万円
島根県農業協同組合	21,216百万円
広島市農業協同組合	10,501百万円
ひろしま農業協同組合	16,731百万円 (2023年4月3日現在)
山口県農業協同組合	16,206百万円
徳島市農業協同組合	4,128百万円
香川県農業協同組合	23,986百万円
越智今治農業協同組合	6,265百万円
高知市農業協同組合	5,130百万円
福岡八女農業協同組合	3,181百万円
宮崎県農業協同組合	25,271百万円 (2024年4月1日現在)
沖縄県農業協同組合	24,012百万円

2【関係業務の概要】

- (1) 受託会社
ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行ないます。
- (2) 販売会社
日本におけるファンドの募集、解約、収益分配金および償還金の取扱いなどを行ないます。

3【資本関係】

- (1) 受託会社
該当事項はありません。
- (2) 販売会社
該当事項はありません。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2023年12月28日	臨時報告書
2024年 3月15日	有価証券届出書
2024年 3月15日	有価証券報告書
2024年 3月29日	臨時報告書

独立監査人の監査報告書

2024年6月13日

日興アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 秋 宗 勝 彦指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 三 上 和 彦

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている日興アセットマネジメント株式会社の2023年4月1日から2024年3月31日までの第65期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日興アセットマネジメント株式会社の2024年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査等委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連

する注記事項の妥当性を評価する。

- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査等委員会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注)1. 上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2024年9月4日

日興アセットマネジメント株式会社
取締役会御中

PwC Japan有限責任監査法人
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 辻村 和之
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 榊原 康太
業務執行社員

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型の2023年12月16日から2024年6月17日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、世界の財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型の2024年6月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、日興アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

その他の記載内容は、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む。）に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうかを検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立

案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

- ・ 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

日興アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注)1.上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。

2.XBRLデータは監査の対象には含まれていません。